

TEB Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu  
Mart 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	4,250,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	669,147,908.48
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	170,528,164.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	27/12/1994
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	3.923973
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	3.893706
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.78%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	2.24%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	8.52%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	

Hisse Senedi	
Varant	
Devlet Tahvili	42.57%
Özel Sektör Tahvili	
Finansman Bonosu	5.72%
Banka Bonosu	33.79%
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	5.78%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	9.16%
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	
Yabancı Sabit Getirili	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	2.99%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	34.10%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	35.89%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	92.902
J. AYLIK KORELASYON :	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :	
L. AYLIK TAKİP HATASI :	
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :	
N. AYLIK TAKİP FARKI :	
O. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI :	
P. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :	
R. GEÇEN AYKİ TAKİP FARKI :	
S. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	1,138,901,901.08
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	1,104,254,078.69

## 3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT080616T16	1,000,000.00	983,875.17	0.15%
TRT130416T11	27,100,000.00	27,021,064.48	4.03%
TRT130416T11	9,100,000.00	9,073,493.97	1.35%
TRT130716T18	151,000,000.00	152,953,743.70	22.82%
TRT130716T18	13,500,000.00	13,674,672.45	2.04%
TRT141216T10	66,000,000.00	61,631,386.08	9.20%
TRT161116T19	29,100,000.00	29,690,150.04	4.43%
TRT161116T19	5,000,000.00	5,101,400.35	0.76%
TRT170816T13	19,000,000.00	18,331,209.31	2.74%
TOPLAM :	320,800,000.00	318,460,995.55	47.52%
D) BANKA BONOLARI:			
TRQAKBK41615	28,000,000.00	27,918,542.96	4.17%
TRQAKBK71612	15,000,000.00	14,555,330.70	2.17%
TRQGRAN51620	5,000,000.00	4,935,166.15	0.74%
TRQGRAN51638	30,000,000.00	29,620,391.10	4.42%
TRQINGB41610	10,000,000.00	9,985,045.30	1.49%
TRQTCZB41628	6,000,000.00	5,979,639.24	0.89%
TRQTCZB61618	10,000,000.00	9,802,450.10	1.46%
TRQTCZB61626	30,000,000.00	29,407,438.20	4.39%
TRQTEBK81614	10,000,000.00	9,622,107.10	1.44%
TRQTISB41646	19,000,000.00	18,973,806.41	2.83%
TRQVKFB41637	20,000,000.00	20,000,000.00	2.98%
TRQVKFB51628	5,000,000.00	4,923,075.60	0.73%
TRQYKKBK61621	5,000,000.00	4,911,626.00	0.73%
TRQYKKBK71612	10,000,000.00	9,697,948.90	1.45%
TOPLAM :	203,000,000.00	200,332,567.76	29.89%
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFAKYM41624	8,550,000.00	8,513,779.29	1.27%
TRFAKYM61614	3,000,000.00	2,918,236.74	0.44%
TRFGRFA71619	4,000,000.00	3,870,486.68	0.58%
TRFGRFK71618	2,000,000.00	1,931,908.80	0.29%
TRFISMD51649	8,500,000.00	8,381,811.50	1.25%
TRFISMD61648	5,000,000.00	4,884,866.40	0.73%
TRFYKFK71616	4,500,000.00	4,353,027.03	0.65%
TRFYKFK91614	5,000,000.00	4,763,713.10	0.71%
TRFYKYM61614	2,600,000.00	2,550,454.63	0.38%
TRFYKYM61622	6,500,000.00	6,350,389.70	0.95%
TRFYKYM61630	5,000,000.00	4,872,796.85	0.73%
TRFYKYM71613	5,000,000.00	4,860,708.65	0.73%
TOPLAM :	59,650,000.00	58,252,179.37	8.69%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			

O) VOB İŞLEMLERİ:

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:

VL Vadeli Mevduat TL	10,179,139.34	10,087,266.57	1.51%
VL Vadeli Mevduat TL	10,118,907.10	10,055,562.71	1.50%
VL Vadeli Mevduat TL	10,118,469.95	10,051,658.97	1.50%
VL Vadeli Mevduat TL	10,128,142.08	10,036,445.68	1.50%
RRP TRT080616T16	14,504,044.10	14,504,044.10	2.16%
RRP TRT080616T16	200,051.72	200,051.72	0.03%
BPP	5,068,191.78	5,056,459.97	0.75%
BPP	7,090,789.04	7,062,947.21	1.05%
BPP	3,041,071.23	3,021,047.89	0.45%
BPP	7,095,832.88	7,049,111.75	1.05%
BPP	10,037,972.60	10,037,972.60	1.50%
BPP	6,013,808.22	6,007,415.16	0.90%
TOPLAM :	93,596,420.04	93,169,984.33	13.90%
FON PORTFÖY DEĞERİ	677,046,420.04	670,215,727.00	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	670,215,727.00	100.16%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	119,778.32	0.02%
C. ALACAKLAR (+) :	50,173.28	0.01%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	2,330.04	0.00%
E. BORÇLAR (-) :	1,240,100.17	0.19%
FON TOPLAM DEĞERİ:	669,147,908.48	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	1,140,975.66
37002Denetim Ücreti	575.05
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	1,649.36
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	11,201.44
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	7,508.03
37006Saklama Giderleri	11,054.29
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	20,023.79
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	33,457.66
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	5,437.04
37045Fon Saklama Ücreti	22,264.74
37097Kurucuya Ödenecek Gider Karşılığı	23,118.89
37099Diğer Giderler	519.63
TOPLAM	1,277,785.58