

TEB Portföy Dördüncü Değişken Fon
Mart 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy Dördüncü Değişken Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	105,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	3,536,385.07
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	130,487,902.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	01/10/2004
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.027101
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.026432
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	2.53%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	4.29%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.96%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	12.64%
Varant	
Devlet Tahvili	59.49%
Özel Sektör Tahvili	2.84%
Finansman Bonosu	2.80%
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	16.65%
Kıymetli Madenler	0.55%
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	
Yabancı Sabit Getiriler	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	5.03%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	1.09%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	83.05%
Devlet Borçlanma Senetleri	19.08%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	639.758
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:	344,148.46
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	340,119.50

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	3,250.00	26,065.00	0.74%
AKCNS	675	9,699.75	0.27%
AKSEN	4,225.00	11,449.75	0.32%
ANHYT	1,275.00	7,127.25	0.20%
AYGAZ	775	9,455.00	0.27%
BIMAS	185	11,294.25	0.32%
CIMSA	650	10,231.00	0.29%
EKGYO	6,250.00	17,937.50	0.51%
FROTO	300	11,142.00	0.32%
GARAN	4,500.00	37,080.00	1.05%
HALKB	1,025.00	10,731.75	0.30%
ISCTR	6,850.00	31,921.00	0.90%
KCHOL	550	7,870.50	0.22%
MGROS	875	15,618.75	0.44%
SAHOL	2,475.00	24,106.50	0.68%
SODA	1,750.00	8,907.50	0.25%
TAVHL	1,000.00	16,810.00	0.48%
THYAO	2,250.00	17,527.50	0.50%
TTKOM	2,300.00	15,364.00	0.43%
TTRAK	200	16,790.00	0.48%
TUPRS	375	29,756.25	0.84%
ULKER	875	18,287.50	0.52%
VAKBN	2,475.00	11,657.25	0.33%
TOPLAM :	45,085.00	376,830.00	10.66%
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT040516T11	100,000.00	149,616.98	4.23%
TRT050220T17	20,000.00	18,802.25	0.53%
TRT080317T18	1,000,000.00	998,113.77	28.25%
TRT100719T18	22,000.00	21,724.22	0.61%
TRT120122T17	14,000.00	14,134.72	0.40%
TRT140922T17	514,000.00	485,278.94	13.73%
TRT141118T19	20,000.00	20,258.65	0.57%
TRT141216T10	400,000.00	373,523.55	10.57%
TRT270319T13	12,000.00	12,238.01	0.35%
TOPLAM :	2,102,000.00	2,093,691.09	59.26%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFAKYM41624	100,000.00	99,576.37	2.82%
TOPLAM :	100,000.00	99,576.37	2.82%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSKCTF81714	100,000.00	101,050.80	2.86%
TOPLAM :	100,000.00	101,050.80	2.86%
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:			
XGOLD_0995	1	111,127.98	3.15%
TOPLAM :	1	111,127.98	3.15%
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	71,280.66	70,637.43	2.00%
VL Vadeli Mevduat TL	71,802.77	71,353.27	2.02%
VL Vadeli Mevduat TL	75,888.52	75,387.44	2.13%
VL Vadeli Mevduat TL	75,961.07	75,273.35	2.13%
BPP	101,369.04	100,934.20	2.86%
BPP	101,405.07	100,899.62	2.86%
BPP	101,513.15	100,903.83	2.86%
BPP	100,792.60	100,653.64	2.85%
BPP	2,000.71	2,000.71	0.06%
BPP	53,018.73	53,018.73	1.50%
TOPLAM :	755,032.32	751,062.22	21.26%
FON PORTFÖY DEĞERİ	3,102,118.32	3,533,338.45	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	3,533,338.45	99.91%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	9,566.78	0.27%
C. ALACAKLAR (+) :	3,537.34	0.10%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	2,330.04	0.07%
E. BORÇLAR (-) :	12,387.54	0.35%
FON TOPLAM DEĞERİ:	3,536,385.07	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	6,802.88
37002Denetim Ücreti	373.55
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	5.12
37004Aracılık Komisyonu	233.81
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	154.97
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	176.83
37024KM İşlemi Komisyonları	14.7
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	29.65
37045Fon Saklama Ücreti	120.94
37099Diğer Giderler	272.37
TOPLAM	8,184.82