

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Temmuz-2021

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	12.660.476,03
E-) Katılma Payı Sayısı	:	12.025.000,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	01 Mart 2021
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,052846
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,031423
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,08
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	5,28
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	5,62
b-)Hazine Bonosu	:	4,05
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	4,79
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	9,65
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	72,80
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,00
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	1,94
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,21
r-)Repo-Trepo	:	0,94
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,05
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	38,56
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	129.917,50

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ																			
Hisse Türk																			
AEFES	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9			2.240,00	22,873781	05/05/21			8010051-		22,220000	49.772,80	5,75	0,39	0,39
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			4.900,00	5,228022	17/06/21			80100519		5,260000	25.774,00	2,98	0,20	0,20
ALKIM	TL	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			TRAALKIM91E0			1.000,00	14,990000	14/07/21			80100511		14,970000	14.970,00	1,73	0,12	0,12
ARDYZ	TL	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.			TREARDY00023			300,00	52,000000	30/07/21			80100512		51,900000	15.570,00	1,80	0,12	0,12
AYGAZ	TL	AYGAZ A.Ş.			TRAAYGAZ91E0			2.000,00	15,865000	02/04/21			8010051-		14,530000	29.060,00	3,35	0,23	0,23
CCOLA	TL	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.			TRECOLA00011			580,00	70,330431	06/05/21			8010051-		84,850000	49.213,00	5,68	0,39	0,39
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			100,00	7,532900	21/06/21			80100511		8,520000	852,00	0,10	0,01	0,01
GWIND	TL	GALATA WIND ENERJİ A.Ş.			TREGWIN00014			5.443,00	5,060000	21/04/21					3,550000	19.322,65	2,23	0,15	0,15
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			5.625,00	4,811604	17/06/21			80100519		5,270000	29.643,75	3,42	0,23	0,23
KAREL	TL	KAREL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.			TREKREL00019			705,00	27,664057	28/06/21			80100511		34,020000	23.984,10	2,77	0,19	0,19

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON																			
Temmuz-2021																			
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
KCHOL	TL	Ş. KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			2.250,00	18,300209	06/05/21			8010051-		20,560000	46.260,00	5,34	0,36	0,37
KRDMĐ	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMR91G7			15.500,00	7,096568	05/05/21			8010051-		7,850000	121.675,00	14,02	0,96	0,96
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			2.050,00	37,556044	18/05/21			80100511		34,100000	69.905,00	8,07	0,55	0,55
OTKAR	TL	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA SANAYİ A.Ş.			TRAOTKAR91H3			350,00	345,062000	30/04/21			8010051-		291,500000	102.025,00	11,78	0,80	0,81
SİSE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALA RI A.Ş.			TRASISEW91Q3			2.300,00	7,238391	07/06/21			80100516		7,590000	17.457,00	2,02	0,14	0,14
TAVHL	TL	TAV HAVALİMA NLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			1.200,00	19,701592	05/05/21			8010051-		22,560000	27.072,00	3,13	0,21	0,21
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			3.400,00	30,413529	21/04/21			8010051-		32,780000	111.452,00	12,87	0,88	0,88
GRUP TOPLAMI								49.943,00								754.008,30	87,04	5,93	5,95
GRUP TOPLAMI								49.943,00								754.008,30	87,04	5,93	5,95
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Özel Sektör																			
TRFVDTFK2116	TL	VOLKSWAGEN DOĞUŞ TÜKETİCİ FİNANSMANI A.Ş.	25/11/21	115	TRFVDTFK2116	20,50		250.000,00	90,772000	28/05/21	21,562904				94,033338	235.083,35	9,48	1,85	1,86
TRFDVYS62214	TL	DÜNYA VARLIK YÖNETİMİ A.Ş.	08/06/22	310	TRFDVYS62214	1,00	4	500.000,00	100,000000	09/06/21	25,776925				103,394722	516.973,61	20,85	4,07	4,08
TRFKCTF62216	TL	KOÇ FİNANSMAN A.Ş.	09/06/22	311	TRFKCTF62216	20,20		300.000,00	83,387000	14/06/21	20,225753				85,474731	256.424,19	10,35	2,02	2,03
TRFMCBF62210	TL	MERCEDES BENZ	16/06/22	318	TRFMCBF62210	20,20	1	300.000,00	100,000000	17/06/21	20,205290				102,346399	307.039,20	12,39	2,42	2,43
TRFMCBF72219	TL	MERCEDES BENZ ORFIN	01/07/22	333	TRFMCBF72219	0,00	1	450.000,00	100,000000	02/07/21	20,205805				101,574884	457.086,98	18,44	3,60	3,61
TRSORFN12217	TL	FINANSMAN	17/01/22	168	TRSORFN12217	0,00	4	250.000,00	95,573100	31/05/21	10,328560		74315606		100,190484	250.476,21	10,11	1,97	1,98
TRSAYGZ62318	TL	AYGAZ A.Ş.	22/06/23	689	TRSAYGZ62318	9,40	4	198.534,00	100,000000	02/07/21	22,182872				101,709736	201.928,41	8,15	1,59	1,59
TRSSRTN72312	TL	SARTEN AMBALAJ SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	07/07/23	704	TRSSRTN72312	1,00	4	250.000,00	100,000000	09/07/21	23,418062				101,389867	253.474,67	10,23	1,99	2,00
GRUP TOPLAMI								2.498.534,00								2.478.486,62	100,00	19,51	19,58
GRUP TOPLAMI								2.498.534,00								2.478.486,62	100,00	19,51	19,58
TPP																			
TPP			02/08/21	0		19,15		466.707,76	19,150000	26/07/21			136801	466.707,76	19,230000	466.707,76	5,14	3,67	3,69
TPP			02/08/21	0		19,15		230.724,03	19,150000	27/07/21			138012	230.724,03	19,230000	230.724,03	2,54	1,82	1,82
TPP			02/08/21	0		19,35		556.176,90	19,350000	29/07/21			139571	556.176,90	19,230000	556.176,90	6,13	4,38	4,39
TPP			03/08/21	1		19,25		2.008.438,36	19,250000	26/07/21			136590	2.008.438,36	19,300000	2.007.377,77	22,12	15,80	15,86
TPP			04/08/21	2		19,25		486.297,34	19,250000	26/07/21			136592	486.297,34	19,260000	485.785,34	5,35	3,82	3,84
TPP			04/08/21	2		19,25		518.449,23	19,250000	26/07/21			136593	518.449,23	19,260000	517.903,38	5,70	4,08	4,09
TPP			04/08/21	2		19,30		1.506.345,21	19,300000	27/07/21			137574	1.506.345,21	19,260000	1.504.759,26	16,57	11,85	11,89
TPP			05/08/21	3		19,30		1.507.138,36	19,300000	27/07/21			137577	1.507.138,36	19,300000	1.504.753,89	16,57	11,85	11,89
TPP			06/08/21	4		19,30		1.808.566,03	19,300000	28/07/21			138498	1.808.566,03	19,310000	1.804.749,91	19,88	14,21	14,25
GRUP TOPLAMI								9.088.843,22								9.078.938,24	100,00	71,48	71,72
GRUP TOPLAMI								9.088.843,22								9.078.938,24	100,00	71,48	71,72
DİĞER																			
Borsa Y.Fonu Yabancı																			
EWJ	USD	ISHARES, INC			US46434G8226			100,00	67,000000	29/07/21					67,110000	56.465,68	6,52	0,45	0,45
IWM	USD	ISHARES, INC			US4642876555			30,00	216,000000	29/07/21					221,050000	55.796,78	6,44	0,44	0,44
GRUP TOPLAMI								130,00								112.262,46	12,96	0,89	0,89
GRUP TOPLAMI								130,00								112.262,46	12,96	0,89	0,89
TÜREV																			
Futures																			
Uzun																			
F_XU0300821	TL				TRVXIST02D73			83,00	1.522,750000	30/07/21			80170126		1.521,000000	1.262.430,00	0,00	0,00	0,00
F_EURUSD0821	USD				TRVXIST02FX5			30,00	1,190000	28/07/21			80176126		1,187600	299.770,43	0,00	0,00	0,00
Kısa																			
F_USDTRY0821	TL				TRVXIST02386			13,00	8,603600	29/07/21			80176126		8,571500	111.429,50	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								126,00								1.673.629,93	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								126,00								1.673.629,93	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								278.675,68								278.675,68	100,00	2,19	
GRUP TOPLAMI								278.675,68								278.675,68	100,00	2,19	
GRUP TOPLAMI								278.675,68								278.675,68	100,00	2,19	
DİĞER																			
Döviz																			
USD	USD	FED			USD			7,05	8,510638	30/07/21					8,413900	59,32	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								7,05								59,32	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								7,05								59,32	0,00	0,00	0,00

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Temmuz-2021

FON PORTFÖY DEĞERİ12.702.371,30100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	12.702.371,30	100,33 %
B-)HAZIR DEĞERLER	2.489,31	0,02 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-44.183,14	-0,35 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	-201,44	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	12.660.476,03	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1.665,84	0,0132 %
Fon Yönetim Ücreti	19.311,98	0,1525 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	920,32	0,0073 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2.557,66	0,0202 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	474,92	0,0038 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	3.871,04	0,0306 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	39,84	0,0003 %
Diğer Harcamalar	925,12	0,0073 %
BİST KYD Ücreti	562,56	0,0044 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	1.543,90	0,0122 %
	31.873,18	0,2518 %

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

B-Geçen Ay İçinde Yatırım Fonlarına İlişkin Mevzuatta Meydana Gelen Değişme ve Hukuki İhtilaflarla İlgili Açıklamalar

IX-PORTFÖYE ALIŞLAR

A) HİSSE SENETLERİ(ALIŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
HISSE TÜRK							
ALKİM	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			09/07/21	15,000	7.500,00	500,00
ALKİM	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			12/07/21	14,980	7.490,00	500,00
ARDYZ	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.			30/07/21	52,050	7.807,50	150,00
ARDYZ	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.			30/07/21	51,950	7.792,50	150,00
HISSE TÜRK				Toplamı:		30590,00	1300,00

B)HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (ALIŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
BONO TÜRK							
TRFMCBF72219	MERCEDES BENZ		01/07/22	02/07/21	100,000	450.000,00	450.000,00

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Temmuz-2021

BONO TÜRK				Toplamı:	450000,00	450000,00
TAHVİL TÜRK						
TRSAYGZ62318	AYGAZ A.Ş.	22/06/23	02/07/21	100,000	198.534,00	198.534,00
TRSSRTN72312	SARTEN AMBALAJ SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	07/07/23	09/07/21	100,000	250.000,00	250.000,00
TAHVİL TÜRK				Toplamı:	448534,00	448534,00

E) DÖVİZ (ALİŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
DÖVİZ							
USD	FED			29/07/21	8,510	112.502,20	13.220,00
DÖVİZ				Toplamı:		112502,20	13220,00

G) TERS REPO

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
T.REPO							
TRT040522T13	HAZİNE		26/07/21	19/07/21		2.000.000,00	2.176.605,00
T.REPO				Toplamı:		2000000,00	2176605,00

I) TAKASBANK PARA PİYASASI

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
TPP							
			08/07/21	01/07/21		2.300.000,00	
			08/07/21	01/07/21		84.000,00	
			09/07/21	02/07/21		1.003.000,00	
			13/07/21	06/07/21		882.000,00	
			14/07/21	08/07/21		1.686.000,00	
			16/07/21	08/07/21		3.000.000,00	
			16/07/21	08/07/21		392.000,00	
			19/07/21	08/07/21		2.500.000,00	
			13/07/21	09/07/21		56.000,00	
			16/07/21	09/07/21		700.000,00	
			26/07/21	13/07/21		900.000,00	
			26/07/21	13/07/21		30.000,00	
			27/07/21	14/07/21		1.650.000,00	
			27/07/21	14/07/21		34.000,00	
			27/07/21	16/07/21		1.500.000,00	
			27/07/21	16/07/21		29.000,00	
			28/07/21	16/07/21		2.450.000,00	
			26/07/21	19/07/21		514.000,00	
			02/08/21	26/07/21		465.000,00	
			03/08/21	26/07/21		2.000.000,00	
			04/08/21	26/07/21		484.000,00	
			04/08/21	26/07/21		516.000,00	
			02/08/21	27/07/21		230.000,00	
			04/08/21	27/07/21		1.500.000,00	
			05/08/21	27/07/21		1.500.000,00	
			29/07/21	28/07/21		320.000,00	
			29/07/21	28/07/21		345.000,00	
			06/08/21	28/07/21		1.800.000,00	
			02/08/21	29/07/21		555.000,00	
TPP				Toplamı:		29425000,00	

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Temmuz-2021

J) VADELİ İŞLEM VE OPSİYON BORSASI (UZUN)

KIYMET	İHRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
FUTURES							
F_XU0300821			31/08/21	06/07/21	1.527,250	152.725,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	06/07/21	1.517,000	151.700,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	08/07/21	1.517,000	151.700,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	09/07/21	1.509,500	150.950,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	09/07/21	1.518,500	151.850,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	12/07/21	1.517,500	151.750,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	16/07/21	1.487,000	148.700,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	19/07/21	1.473,500	147.350,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	19/07/21	1.465,500	146.550,00	10,00
F_XU0300821			31/08/21	27/07/21	1.450,500	145.050,00	10,00
F_EURUSD0821			31/08/21	27/07/21	1,179	151.613,50	15,00
F_XU0300821			31/08/21	28/07/21	1.466,250	146.625,00	10,00
F_EURUSD0821			31/08/21	28/07/21	1,181	151.608,96	15,00
F_XU0300821			31/08/21	30/07/21	1.509,000	150.900,00	10,00
FUTURES						Toplamı:	2099072,47
							150,00

J) VADELİ İŞLEM VE OPSİYON BORSASI (KISA)

KIYMET	İHRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
F_USDTRY0821			31/08/21	29/07/21	8,640	112.320,00	13,00
						Toplamı:	112320,00
							13,00

K)BORSA YATIRIM FONLARI (ALİŞLAR)

KIYMET	İHRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
YABANCI BORSA YATIRIM FONU							
IWM	ISHARES, INC			27/07/21	216,000	6.480,00	30,00
EWJ	ISHARES, INC			27/07/21	67,000	6.700,00	100,00
YABANCI BORSA YATIRIM FONU						Toplamı:	13180,00
							130,00
						34691198,67	3089952,00