

**TEB PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
(ESKİ UNVANIYLA “TEB PORTFÖY BİRİNCİ ORTA
VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU”)**

**1 OCAK 31 ARALIK 2019 DÖNEMİNE AİT
FİYAT RAPORU**

TEB PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU (ESKİ UNVANIYLA “TEB PORTFÖY BİRİNCİ ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU”)

**Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve
Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının
Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor**

Teb Portföy Borçlanma Araçları (Eski Ünvanıyla “Teb Portföy Birinci Orta Vadeli Borçlanma Araçları Fonu”) Fonu’nun (“Fon”) pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) (“Tebliğ”) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca (“SPK”) belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını SPK’nın konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Teb Portföy Borçlanma Araçları (Eski Ünvanıyla “Teb Portföy Birinci Orta Vadeli Borçlanma Araçları Fonu”) Fonu’nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları Tebliğ hükümlerine ve SPK tarafından belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen SPK, Kurucu Yönetim Kurulu ve TEB Portföy Yönetim A.Ş.’nin (“Kurucu”) bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
Member of DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED

Zere Gaye Şentürk, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 30 Nisan 2020

TBT - TEB PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU (ESKİ UNVANIYLA"ING PORTFÖY PARA PİYASASI FONU") 31 Aralık 2019 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR

FON TOPLAM DEĞER TABLOSU

	<u>TUTAR (TL)</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>	<u>FON TOPLAM DEĞERİ</u>	<u>44.881.721.24</u>
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	44,939,650.30		100.13	Toplam Pay Sayısı	150,000,000.000
B. HAZIR DEĞERLER	58,510.13		0.13	Dolaşımdaki Pay	2,224,036.519
a) Kasa	0.00	0.00	0.00	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	147,775,963.481
b) Bankalar	58,510.13	100.00	0.13		
c) Diğer Hazır Değerler	0.00	0.00	0.00	Dolaşımdaki Pay Oranı	% 1.48
				BİRİM PAY DEĞERİ	20.180299
C. ALACAKLAR	0.00		0.00	Günlük Vergi	
a) Takastan Alacaklar Toplamı	0.00	0.00	0.00	Günlük Yönetim Ücreti	5,386.08
i) T1 Alacakları	0.00		0.00	Bir Gün Önceki Fiyat	20.183052
ii) T2 Alacakları	0.00		0.00	Bir Gün Önceki Vergi	0.00
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	0.00		0.00	Getiri (%)	-0.013640
b) Diğer Alacaklar	0.00		0.00		
i) Diğer Alacaklar	0.00		0.00		
ii) Vergi Alacakları	0.00		0.00		
iii) Mevduat Alacakları	0.00		0.00	USD TCMB ALIS KURU	5.9400
iv) Temettü	0.00		0.00	EURO TCMB ALIS KURU	6.6621
	TUTAR	GRUP %	TOPLAM %		
D. BORÇLAR	-116,439.19		-0.26		
a) Takasa Borçlar	0.00	0.00	0.00		
i) T1 Borçları	0.00				
ii) T2 Borçları	0.00				
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	0.00				
iv) İhbarlı FonPay Takas	0.00				
b) Yönetim Ücreti	-96,987.90	83.29	-0.22		
c) Ödenecek Vergi	0.00	0.00	0.00		
d) İhtiyatlar	0.00	0.00	0.00		
e) DİĞER_BORÇLAR	-17,207.20	16.71	-0.04		
i) Diğer Borçlar	-12,570.81		-0.03		
ii) Denetim Reeskontu	-4,636.39		-0.01		
f) Kayda Alma Ücreti	-2,244.09	1.93	-0.01		
g) Krediler	0.00	0.00	0.00		

TBT - TEB PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU (ESKİ UNVANIYLA“İNG PORTFÖY PARA PİYASASI FONU”)□

TBT - TEB PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU (ESKİ UNVANIYLA“İNG PORTFÖY PARA PİYASASI FONU”) 31 Aralık 2019 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİN AL 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)
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvili																		
TRT150120T16	TL	HAZİNE	15/01/20		0.00		500,000.00	98.340700	18/12/19	10.577469		718495947847677265		104.873764	524,368.82	1.17	1.17	1.17
TRT080720T19	TL	HAZİNE	08/07/20		13.10		3,001,485.00	97.335100	02/12/19	10.807581				104.001476	3,121,588.70	6.99	6.95	6.96
TRT120820T12	TL	HAZİNE	12/08/20		0.00		2,044,291.00	110.466800	13/09/19	10.712695		718456365429577723		116.147758	2,374,398.15	5.31	5.28	5.29
TRT160920T25	TL	HAZİNE	16/09/20		0.00		3,500,000.00	86.707800	01/10/19	11.307437		719168848964158756		92.707402	3,244,759.09	7.26	7.22	7.23
TRT071020T23	TL	HAZİNE	07/10/20		0.00		4,500,000.00	90.344100	31/12/19	11.274000		721385464405814499		92.158929	4,147,151.80	9.28	9.23	9.24
TRT170221T12	TL	HAZİNE	17/02/21		0.00		4,200,512.00	97.036400	18/11/19	11.445839		720989915097722487		103.491436	4,347,170.18	9.73	9.67	9.69
TRT210421T14	TL	HAZİNE	21/04/21		0.00		6,000,000.00	114.157200	26/12/19	11.474464		722296959544997651		115.577763	6,934,665.77	15.51	15.40	15.45
TRT201021T25	TL	HAZİNE	20/10/21		0.00		2,000,000.00	103.693700	08/11/19	11.772296		720713113045196292		106.443890	2,128,877.80	4.76	4.74	4.74
TRT120122T17	TL	HAZİNE	12/01/22		0.00		500,000.00	85.085900	09/10/19	11.676080		719050101707899508		101.170201	505,851.00	1.13	1.13	1.13
TRT020322T17	TL	HAZİNE	02/03/22		0.00		400,000.00	92.234100	17/06/19	11.709747		710025310267354718		102.928443	411,713.77	0.92	0.92	0.92
TRT170822T15	TL	HAZİNE	17/08/22		13.12		2,970,000.00	92.957000	27/11/19	11.765559				102.342363	3,039,568.19	6.80	6.76	6.77
TRT140922T17	TL	HAZİNE	14/09/22		0.00		100,000.00	92.609900	11/11/19	11.437020		720593816033727114		96.513252	96,513.25	0.22	0.22	0.22
TRT180123T10	TL	HAZİNE	18/01/23		0.00		500,000.00	97.451500	23/10/19	11.659118		719168848964189146		107.670042	538,350.21	1.20	1.20	1.20
TRT080323T10	TL	HAZİNE	08/03/23		0.00		1,000,000.00	82.789000	25/10/19	11.918713		720158684306930051		90.580868	905,808.68	2.03	2.02	2.02
TRT140623T19	TL	HAZİNE	14/06/23		0.00		1,100,000.00	112.216800	07/10/19	11.696250		719327178638406406		114.241217	1,256,653.39	2.81	2.80	2.80
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23		0.00		800,000.00	85.254200	19/09/19	11.807745		718733442359411107		94.309667	754,477.34	1.69	1.68	1.68
TRT240724T15	TL	HAZİNE	24/07/24		0.00		1,000,000.00	87.532500	06/11/19	12.237719		720593816033726687		93.966430	939,664.30	2.10	2.09	2.09
TRT120325T12	TL	HAZİNE	12/03/25		0.00		1,000,000.00	84.526900	06/11/19	12.137249		720593816033842443		87.972199	879,721.99	1.97	1.96	1.96
TRT110226T13	TL	HAZİNE	11/02/26		0.00		1,500,000.00	94.659400	27/11/19	12.379178		720989915097725195		97.979646	1,469,694.70	3.29	3.27	3.27
TRT110827T16	TL	HAZİNE	11/08/27		0.00		2,000,000.00	93.259600	26/12/19	12.328297		722098222818012050		96.769628	1,935,392.56	4.33	4.31	4.31
GRUP TOPLAMI							38,616,288.00								39,556,389.69	88.50	88.02	88.14
Özel Sektör																		
Finansman Bonosu																		
TRFFNBK22025	TL	FINANSBANK A.Ş.	14/02/20		11.40		1,000,000.00	97.444000	22/11/19	11.700213				98.704930	987,049.30	2.21	2.20	2.20
TRFVKFB52017	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	08/05/20		11.70		500,000.00	94.688000	15/11/19	12.057770				96.116268	480,581.34	1.08	1.07	1.07
TRFFFKR62015	TL	FINANS FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	09/06/20		10.75		500,000.00	95.312000	25/12/19	11.064596				95.531479	477,657.39	1.07	1.06	1.06
GRUP TOPLAMI							2,000,000.00								1,945,288.03	4.36	4.33	4.33
Özel Sektör Tahvil																		
TRSHYTV22012	TL	HAYAT VARLIK YÖNETİMİ A.Ş	04/02/20		0.00		500,000.00	100.079600	12/02/19	19.436569		710064892685847948		102.862562	514,312.81	1.15	1.14	1.15
TRSRNSH22023	TL	RÖNESANS HOLDİNG PALGAZ	19/02/20		18.09		500,000.00	103.242900	25/10/19	15.431538				101.800555	509,002.78	1.14	1.13	1.13
TRSPLDG52014	TL	DOĞALGAZ DAĞITIM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	14/05/20		41.27		300,000.00	103.892400	25/10/19	17.796388				102.238361	306,715.08	0.69	0.68	0.68
TRFTCZB82013	TL	TC ZİRAAT BANKASI	27/08/20		17.39		610,000.00	100.818400	25/10/19	11.687646				102.253073	623,743.75	1.40	1.39	1.39
TRSARCL22117	TL	ARÇELİK A.Ş.	12/02/21		18.10		170,000.00	103.368600	25/10/19	15.208035				101.731151	172,942.96	0.39	0.38	0.39
TRSOPAS22111	TL	OPET	18/02/21		22.15		350,000.00	101.841700	08/02/19	14.911747				101.080090	353,780.31	0.79	0.79	0.79
TRSOPAS22129	TL	PETROLÇÜLÜK A.Ş.	19/02/21		17.88		200,000.00	104.042100	25/10/19	14.096806				102.438093	204,876.19	0.46	0.46	0.46
TRSVKFB92719	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	06/09/27		18.22		250,000.00	101.950700	25/10/19	16.252471				100.250410	250,626.02	0.56	0.56	0.56
TRSTISB62911	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.	06/06/29		17.12		250,000.00	101.719500	25/10/19	13.724636				100.729893	251,824.73	0.56	0.56	0.56
GRUP TOPLAMI							3,130,000.00								3,187,824.63	7.14	7.09	7.11
GRUP TOPLAMI							5,130,000.00								5,133,112.66	11.50	11.42	11.44
GRUP TOPLAMI							43,746,288.00								44,689,502.35	100.00	99.44	99.58
TPP																		
TPP			02/01/20		10.80		250,147.95	10.800000	31/12/19			228661	250,147.95	10.780000	250,147.95	100.00	0.56	0.56
GRUP TOPLAMI							250,147.95								250,147.95	100.00	0.56	0.56
GRUP TOPLAMI							250,147.95								250,147.95	100.00	0.56	0.56
FON PORTFÖY DEĞERİ															44,939,650.30		100.00	