

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Mayıs-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	:	11.623.357,48
E-) Katılma Payı Sayısı	:	11.400.000,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	01 Mart 2021
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,018016
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,001399
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	1,66
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1,80
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	11,87
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,25
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,23
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	85,40
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	:	2,25
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	0,00
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00

G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,05
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	10,62

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	2.004.765,65
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00

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-		22,860000	51.206,40	5,10	0,44	0,44
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			12.900,00	5,228022	05/05/21			8010051-		5,200000	67.080,00	6,68	0,58	0,58
AYGAZ	TL	AYGAZ A.Ş.			TRAAYGAZ91E0			2.000,00	15,865000	02/04/21			8010051-		14,060000	28.120,00	2,80	0,24	0,24
CCOLA	TL	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.			TRECOLA00011			580,00	70,330431	06/05/21			8010051-		79,400000	46.052,00	4,58	0,40	0,40
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			10.100,00	7,532936	20/05/21			80100511		7,990000	80.699,00	8,03	0,69	0,69
GWIND	TL	GALATA WIND ENERJİ A.Ş.			TREGWIN00014			5.443,00	5,060000	21/04/21					4,120000	22.425,16	2,23	0,19	0,19
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			14.625,00	4,811603	06/05/21			8010051-		5,090000	74.441,25	7,41	0,64	0,64
KAREL	TL	KAREL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TREKREL00019			2.705,00	27,664055	21/05/21			80100511		32,120000	86.884,60	8,65	0,75	0,75
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			2.250,00	18,300209	06/05/21			8010051-		18,580000	41.805,00	4,16	0,36	0,36
KRDM	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR			TRAKRDMR91G7			15.500,00	7,096568	05/05/21			8010051-		7,860000	121.830,00	12,12	1,05	1,05

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON																				
Mayıs-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)	
MGROS	TL	ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D) MIGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			2.050,00	37,556044	18/05/21			80100511		34,640000	71.012,00	7,07	0,61	0,61	
OTKAR	TL	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA SANAYİ A.Ş.			TRAOTKAR91H3			350,00	345,062000	30/04/21			8010051-		302,800000	105.980,00	10,55	0,91	0,91	
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			10.300,00	7,238391	21/05/21			80100511		7,750000	79.825,00	7,94	0,69	0,69	
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			1.200,00	19,701592	05/05/21			8010051-		23,980000	28.776,00	2,86	0,25	0,25	
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			3.400,00	30,413529	21/04/21			8010051-		29,020000	98.668,00	9,82	0,85	0,85	
GRUP TOPLAMI								85.643,00									1.004.804,41	100,00	8,65	8,65
GRUP TOPLAMI								85.643,00									1.004.804,41	100,00	8,65	8,65
BORÇLANMA SENETLERİ																				
Özel Sektör																				
TRFVDTFK2116	TL	VOLKSWAGEN DOĞUŞ TÜKETİCİ FİNANSMANI A.Ş. ORFİN FİNANSMAN	25/11/21	177	TRFVDTFK2116	20,50		250.000,00	90,772000	28/05/21	21,560680				90,966429	227.416,07	47,37	1,96	1,96	
TRSORFN12217	TL		17/01/22	230	TRSORFN12217	0,00	4	250.000,00	95,573100	31/05/21	0,000000		74315606		101,083189	252.707,97	52,63	2,17	2,17	
GRUP TOPLAMI								500.000,00									480.124,04	100,00	4,13	4,13
GRUP TOPLAMI								500.000,00									480.124,04	100,00	4,13	4,13
TPP																				
TPP			01/06/21	0		19,20		2.510.520,55	19,200000	24/05/21			97003	2.510.520,55	19,390000	2.510.520,55	25,30	21,58	21,60	
TPP			01/06/21	0		19,20		276.157,26	19,200000	24/05/21			97127	276.157,26	19,390000	276.157,26	2,78	2,37	2,38	
TPP			02/06/21	1		19,10		543.568,29	19,100000	31/05/21			102095	543.568,29	19,100000	543.284,07	5,47	4,67	4,67	
TPP			07/06/21	6		19,25		2.324.260,27	19,250000	18/05/21			94147	2.324.260,27	19,390000	2.316.877,42	23,35	19,91	19,93	
TPP			07/06/21	6		19,20		276.446,58	19,200000	28/05/21			101135	276.446,58	19,390000	275.568,47	2,78	2,37	2,37	
TPP			11/06/21	10		19,20		4.023.145,21	19,200000	31/05/21			102093	4.023.145,21	19,200000	4.002.098,60	40,32	34,39	34,43	
GRUP TOPLAMI								9.954.098,16									9.924.506,37	100,00	85,29	85,38
GRUP TOPLAMI								9.954.098,16									9.924.506,37	100,00	85,29	85,38
TÜREV																				
Futures																				
Kısa																				
F_XU0300621	TL				TRVXIST02A76			67,00	1.529,250000	28/05/21			80170126		1.524,750000	1.021.582,50	0,00	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								67,00									1.021.582,50	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								67,00									1.021.582,50	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																				
VIOP Nakit Teminatı								224.773,19									224.773,19	100,00	1,93	
GRUP TOPLAMI								224.773,19									224.773,19	100,00	1,93	
GRUP TOPLAMI								224.773,19									224.773,19	100,00	1,93	
FON PORTFÖY DEĞERİ																11.634.208,01		100,00		

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	11.634.208,01	100,09 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3.247,90	0,03 %
C-)ALACAKLAR	6.015,19	0,05 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-20.113,62	-0,17 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	11.623.357,48	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1.229,42	0,0106 %
Fon Yönetim Ücreti	13.823,47	0,1189 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2.737,25	0,0235 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	3.208,25	0,0276 %
Diğer Harcamalar	725,00	0,0062 %

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Mayıs-2021

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Otomatik BPP Faiz BSMV	1.142,67	0,0098 %
	22.866,06	0,1966 %

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
TCELL	Temmettü	04/05/21	1.853,15	1.853,15
CCOLA	Temmettü	31/05/21	1.142,60	1.142,60

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

VII-PORTFÖYDEN SATIŞLAR

A) HİSSE SENETLERİ(SATIŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
HISSE TÜRK							
TAVHL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			03/05/21	22,300	33.450,00	1.500,00
TAVHL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			03/05/21	22,440	33.660,00	1.500,00
CCOLA	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.			03/05/21	79,900	31.960,00	400,00
KRDMD	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			03/05/21	7,260	43.560,00	6.000,00
AEFES	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			03/05/21	23,960	47.920,00	2.000,00
KRDMD	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			03/05/21	7,340	44.040,00	6.000,00
KRDMD	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			03/05/21	7,390	44.340,00	6.000,00
TAVHL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			03/05/21	22,860	34.290,00	1.500,00
KCHOL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			03/05/21	18,720	56.160,00	3.000,00
GARAN	GARANTI BANKASI			03/05/21	7,300	73.000,00	10.000,00
AKBNK	AKBANK T.A.Ş.			03/05/21	4,980	49.800,00	10.000,00
ISCTR	T.İŞ BANKASI A.S.			03/05/21	4,950	49.500,00	10.000,00
GARAN	GARANTI BANKASI			04/05/21	7,380	36.900,00	5.000,00
KCHOL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			04/05/21	19,020	38.040,00	2.000,00
CCOLA	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.			04/05/21	81,150	32.460,00	400,00
ISCTR	T.İŞ BANKASI A.S.			04/05/21	4,950	24.750,00	5.000,00
MGROS	MİGROS TİCARET A.Ş.			06/05/21	37,720	56.580,00	1.500,00
KAREL	KAREL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			07/05/21	32,000	16.000,00	500,00
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			07/05/21	2,090	41.800,00	20.000,00
TCELL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			10/05/21	15,280	30.560,00	2.000,00
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			10/05/21	2,140	32.100,00	15.000,00
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			10/05/21	2,150	25.262,50	11.750,00

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Mayıs-2021

MGROS	MİGROS TİCARET A.Ş.	12/05/21	37,280	18.640,00	500,00
MGROS	MİGROS TİCARET A.Ş.	12/05/21	37,660	18.830,00	500,00
TCELL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.	17/05/21	15,480	42.260,40	2.730,00
KAREL	KAREL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	17/05/21	31,480	31.480,00	1.000,00
GARAN	GARANTİ BANKASI	17/05/21	7,920	23.760,00	3.000,00
KAREL	KAREL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	18/05/21	32,280	24.210,00	750,00
SISE	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.	18/05/21	8,140	32.560,00	4.000,00
HISSE TÜRK				Toplamı:	1067872,90
					133530,00

IX-PORTFÖYE ALIŞLAR

B)HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (ALIŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
BONO TÜRK							
TRFVDTFK2116	VOLKSWAGEN DOĞUŞ TÜKETİCİ FİNANSMANI A.Ş.		25/11/21	28/05/21	90,772	226.930,00	250.000,00
BONO TÜRK				Toplamı:		226930,00	250000,00
TAHVİL TÜRK							
TRSORFN12217	ORFIN FİNANSMAN		17/01/22	28/05/21	95,573	238.932,85	250.000,00
TAHVİL TÜRK				Toplamı:		238932,85	250000,00

I) TAKASBANK PARA PİYASASI

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
TPP							
			11/05/21	03/05/21		330.000,00	
			17/05/21	03/05/21		1.000.000,00	
			17/05/21	03/05/21		93.000,00	
			11/05/21	04/05/21		72.000,00	
			18/05/21	05/05/21		2.193.000,00	
			17/05/21	06/05/21		2.306.000,00	
			18/05/21	10/05/21		56.000,00	
			20/05/21	11/05/21		460.000,00	
			24/05/21	17/05/21		2.073.000,00	
			24/05/21	17/05/21		2.927.000,00	
			24/05/21	17/05/21		755.000,00	
			07/06/21	18/05/21		2.300.000,00	
			31/05/21	20/05/21		560.000,00	
			31/05/21	21/05/21		57.000,00	
			28/05/21	24/05/21		500.000,00	
			31/05/21	24/05/21		2.500.000,00	
			01/06/21	24/05/21		2.500.000,00	
			01/06/21	24/05/21		275.000,00	
			07/06/21	28/05/21		275.000,00	
			02/06/21	31/05/21		543.000,00	
			11/06/21	31/05/21		4.000.000,00	
TPP				Toplamı:		25775000,00	

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Mayıs-2021

J) VADELİ İŞLEM VE OPSİYON BORSASI (KISA)

KIYMET	İHRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
FUTURES							
F_XU0300621			30/06/21	03/05/21	1.485,000	371.250,00	25,00
F_XU0300621			30/06/21	03/05/21	1.494,000	597.600,00	40,00
F_XU0300621			30/06/21	03/05/21	1.504,000	376.000,00	25,00
F_XU0300621			30/06/21	07/05/21	1.529,000	305.800,00	20,00
F_XU0300621			30/06/21	28/05/21	1.527,000	152.700,00	10,00
F_XU0300621			30/06/21	28/05/21	1.531,000	153.100,00	10,00
FUTURES						Toplamı:	130,00
						29265185,75	633660,00