

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Ekim-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	:	15.132.977,93
E-) Katılma Payı Sayısı	:	13.750.000,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	01 Mart 2021
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,100580
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,074624
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,42
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	10,06
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri		
a-)Hisse Senedi	:	3,03
b-)Hazine Bonosu	:	2,82
c-)Devlet Tahvili	:	2,98
d-)Özel Sektör Tahvili	:	5,85
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	42,52
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	37,87
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	:	4,24
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,69
r-)Repo-Trepo	:	0,00
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,01
b-)Hazine Bonosu	:	0,17
c-)Devlet Tahvili	:	0,10
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
H-)Portföyün Ortalama Vadeleri	:	85,88
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	1.196.715,95
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	6.595.456,80

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																			
ARDYZ	TL	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.			TREARDY00023			1.600,00	51,612500	27/08/21			80100512		45,640000	73.024,00	10,65	0,48	0,48
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			5.000,00	18,592000	27/08/21			80100512		19,690000	98.450,00	14,36	0,65	0,65
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			100,00	9,465400	14/10/21			80100514		9,850000	985,00	0,14	0,01	0,01
GWIND	TL	GALATA WIND ENERJİ A.Ş.			TREGWIN00014			5.443,00	5,060000	21/04/21					4,320000	23.513,76	3,43	0,16	0,16
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMR91G7			18.000,00	7,190100	05/08/21			80100512		7,460000	134.280,00	19,60	0,88	0,89
OTKAR	TL	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA SANAYİ A.Ş.			TRAOTKAR91H3			250,00	345,062000	14/09/21			80100513		337,000000	84.250,00	12,29	0,56	0,56
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			1.200,00	19,701592	05/05/21			8010051-		26,580000	31.896,00	4,65	0,21	0,21
YKBNK	TL	YAPI VE			TRAYKBNK91N6			40.000,00	2,545000	31/08/21			80100512		2,730000	109.200,00	15,93	0,72	0,72

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON

Ekim-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)				
		KREDİ BANKASI A.Ş.																					
GRUP TOPLAMI								71.593,00												555.598,76	81,05	3,67	3,68
GRUP TOPLAMI								71.593,00												555.598,76	81,05	3,67	3,68
BORÇLANMA SENETLERİ																							
Özel Sektör																							
TRFVDTFK2116	TL	VOLKSWAGEN DOĞUŞ TÜKETİCİ FİNANSMA Nİ A.Ş.	25/11/21	24	TRFVDTFK2116	20,50		250.000,00	90,772000	28/05/21	22,303928				98,684852	246.712,13	2,32	1,63	1,63				
TRFGRFAA2112	TL	GARANTİ FAKTORİN G A.Ş.	01/12/21	30	TRFGRFAA2112	19,15		700.000,00	95,443000	01/09/21	20,553056				98,475414	689.327,90	6,49	4,55	4,56				
TRFALNFA2119	TL	ALTERNATİ FBANK A.Ş.	16/12/21	45	TRFALNFA2119	19,30		700.000,00	93,987000	17/08/21	20,570704				97,720097	684.040,68	6,44	4,51	4,52				
TRFISGYA2110	TL	İŞ GAYRİMEN KUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	16/12/21	45	TRFISGYA2110	19,15		460.000,00	94,077000	18/08/21	20,417554				97,735411	449.582,89	4,23	2,96	2,97				
TRFFFKR12218	TL	FINANS FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	11/01/22	71	TRFFFKR12218	19,15		700.000,00	93,523000	01/09/21	20,341369				96,462306	675.236,14	6,36	4,45	4,46				
TRFDZFK22215	TL	DENİZ FAKTORİN G A.Ş.	02/02/22	93	TRFDZFK22215	0,75	3	600.000,00	100,000000	18/08/21	19,371424				101,657363	609.944,18	5,74	4,02	4,03				
TRFGRAN32219	TL	GARANTİ BANKASI TAM FİNANS FAKTORİN G A.Ş.	10/03/22	129	TRFGRAN32219	0,00	2	500.000,00	100,000000	15/09/21	19,387774				102,377898	511.889,49	4,82	3,38	3,38				
TRFTAMF42218	TL	TAM FİNANS FAKTORİN G A.Ş.	01/04/22	151	TRFTAMF42218	5,00	2	1.000.000,00	100,000000	05/10/21	22,669983				101,555169	1.015.551,69	9,56	6,70	6,71				
TRFYKBK42236	TL	YAPI KREDİ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	15/04/22	165	TRFYKBK42236	4,10	4	500.000,00	100,000000	17/09/21	18,266010				102,147858	510.739,29	4,81	3,37	3,38				
TRFDVYS62214	TL	DÜNYA VARLIK YÖNETİMİ A.Ş.	08/06/22	219	TRFDVYS62214	1,00	4	500.000,00	100,000000	09/06/21	23,558803				103,733085	518.665,42	4,88	3,42	3,43				
TRFKCTF62216	TL	KOÇ FİNANSMA N A.Ş.	09/06/22	220	TRFKCTF62216	20,20		300.000,00	83,387000	14/06/21	19,136975				89,983672	269.951,02	2,54	1,78	1,78				
TRFMCBF62210	TL	MERCEDES BENZ	16/06/22	227	TRFMCBF62210	20,20	1	300.000,00	100,000000	17/06/21	19,088440				107,775478	323.326,43	3,04	2,13	2,14				
TRFMCBF72219	TL	MERCEDES BENZ	01/07/22	242	TRFMCBF72219	0,00	1	450.000,00	100,000000	02/07/21	19,256582				106,904446	481.070,01	4,53	3,17	3,18				
TRFDZBK72219	TL	DENİZBAN K A.Ş.	07/07/22	248	TRFDZBK72219	10,00	4	500.000,00	100,000000	20/08/21	19,563942				101,007766	505.038,83	4,75	3,33	3,34				
TRFKCTF92213	TL	KOÇ FİNANSMA N A.Ş.	19/09/22	322	TRFKCTF92213	0,00	1	340.000,00	100,000000	22/09/21	18,879249				102,367954	348.051,04	3,28	2,30	2,30				
TRFMCFE2215	TL	MERCEDES BENZ	06/10/22	339	TRFMCFE2215	2,50	2	700.000,00	100,000000	07/10/21	18,779986				101,207926	708.455,48	6,67	4,67	4,68				
TRSORFN12217	TL	ORFIN FİNANSMA N	17/01/22	77	TRSORFN12217	0,00	4	250.000,00	95,573100	31/05/21	10,328560		74315606		100,190686	250.476,72	2,36	1,65	1,66				
TRSKCTF32311	TL	KOÇ FİNANSMA N A.Ş.	03/03/23	487	TRSKCTF32311	30,03	1	350.000,00	100,000000	01/09/21	19,113138				102,966189	360.381,66	3,39	2,38	2,38				
TRSAYGZ62318	TL	AYGAZ A.Ş.	22/06/23	598	TRSAYGZ62318	9,40	4	198.534,00	100,000000	02/07/21	20,514281				101,650250	201.810,31	1,90	1,33	1,33				
TRSSRTN72312	TL	SARTEN AMBALAJ SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	07/07/23	613	TRSSRTN72312	1,00	4	250.000,00	100,000000	09/07/21	21,453912				101,348785	253.371,96	2,39	1,67	1,67				
TRSENSAE2312	TL	ENERJISA ENERJİ A.Ş.	13/10/23	711	TRSENSAE2312	10,00	4	1.000.000,00	100,000000	15/10/21	19,840789				100,866369	1.008.663,69	9,50	6,65	6,67				
GRUP TOPLAMI								10.548.534,00												10.622.286,96	100,00	70,05	70,20
GRUP TOPLAMI								10.548.534,00												10.622.286,96	100,00	70,05	70,20
TPP																							
TPP			01/11/21	0		16,80		1.504.832,88	16,800000	25/10/21			197861	1.504.832,88	16,070000	1.504.832,88	48,94	9,92	9,94				
TPP			01/11/21	0		16,65		5.015,97	16,650000	25/10/21			198041	5.015,97	16,070000	5.015,97	0,16	0,03	0,03				
TPP			02/11/21	1		16,80		1.565.744,22	16,800000	25/10/21			197876	1.565.744,22	16,500000	1.565.037,38	50,90	10,31	10,34				
GRUP TOPLAMI								3.075.593,07												3.074.886,23	100,00	20,26	20,31
GRUP TOPLAMI								3.075.593,07												3.074.886,23	100,00	20,26	20,31
DİĞER																							
Borsa Y.Fonu Yabancı																							
EWJ	USD	ISHARES, INC			US46434G8226			100,00	67,000000	29/07/21					68,500000	64.946,91	9,48	0,43	0,43				
IWM	USD	ISHARES, INC			US4642876555			30,00	216,000000	29/07/21					228,110000	64.883,38	9,47	0,43	0,43				
GRUP TOPLAMI								130,00												129.830,29	18,95	0,86	0,86
GRUP TOPLAMI								130,00												129.830,29	18,95	0,86	0,86
TÜREV																							
Futures																							
Uzun																							
F_EURUSD1021	USD				TRVXIST02JS7			60,00	1,160000	30/09/21			80176126		1,160000	659.898,48	0,00	0,00	0,00				
Kısa																							
F_USDTRY1221	TL				TRVXIST01YL3			20,00	9,808700	26/10/21					9,918900	198.378,00	0,00	0,00	0,00				
F_XU0301221	TL				TRVXIST02A84			60,00	1.662,000000	26/10/21			80170126		1.660,500000	996.300,00	0,00	0,00	0,00				
GRUP TOPLAMI								140,00												1.854.576,48	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								140,00												1.854.576,48	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																							
VIOP Nakit Teminatı								782.402,55												782.402,55	100,00	5,16	
GRUP TOPLAMI								782.402,55												782.402,55	100,00	5,16	
GRUP TOPLAMI								782.402,55												782.402,55	100,00	5,16	
DİĞER																							
Döviz																							
USD	USD	FED			USD			21,31	8,756922	28/10/21					9,481300	202,05	0,00	0,00	0,00				
GRUP TOPLAMI								21,31												202,05	0,00	0,00	0,00

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON

Ekim-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)
GRUP TOPLAMI								21,31								202,05	0,00	0,00	0,00
FON PORTFÖY DEĞERİ																15.165.004,79		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	15.165.004,79	100,21 %
B-)HAZIR DEĞERLER	6.078,46	0,04 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-37.585,27	-0,25 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	-520,05	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	15.132.977,93	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	4.030,73	0,0266 %
Fon Yönetim Ücreti	26.156,65	0,1728 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	891,56	0,0059 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2.668,61	0,0176 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	242,11	0,0016 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	3.750,07	0,0248 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	39,84	0,0003 %
Diğer Harcamalar	896,42	0,0059 %
BİST KYD Ücreti	544,98	0,0036 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	1.295,75	0,0086 %
	40.516,72	0,2677 %

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

Sirketin Unvanı	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
IWM	Temmettü	01/10/21	14,26	14,26

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

VII-PORTFÖYDEN SATIŞLAR

A) H SSE SENETLER (SATIŞLAR)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
HISSE TÜRK							
GARAN	GARANTI BANKASI			12/10/21	9,530	47.650,00	5.000,00
GARAN	GARANTI BANKASI			12/10/21	9,550	47.750,00	5.000,00
HISSE TÜRK				Toplamı:		95400,00	10000,00

IX-PORTFÖYE ALIŞLAR

B)HAZ NE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (ALIMLAR)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
BONO TÜRK							

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Ekim-2021

TRFTAMF42218	TAM F NANS FACTORING A. .	01/04/22	05/10/21	100,000	1.000.000,00	1.000.000,00
TRFMCBFE2215	MERCEDES BENZ	06/10/22	07/10/21	100,000	700.000,00	700.000,00
BONO TÜRK				Toplamı:	1700000,00	1700000,00
TAHVİL TÜRK						
TRSENSAE2312	ENERJISA ENERJI A. .	13/10/23	15/10/21	100,000	1.000.000,00	1.000.000,00
TAHVİL TÜRK				Toplamı:	1000000,00	1000000,00

I) TAKASBANK PARA P YASASI

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
TPP							
			11/10/21	01/10/21		3.000.000,00	
			12/10/21	01/10/21		25.000,00	
			12/10/21	04/10/21		2.000.000,00	
			12/10/21	04/10/21		205.000,00	
			13/10/21	05/10/21		2.300.000,00	
			13/10/21	05/10/21		10.000,00	
			18/10/21	07/10/21		640.000,00	
			18/10/21	08/10/21		15.000,00	
			15/10/21	11/10/21		585.000,00	
			19/10/21	11/10/21		2.000.000,00	
			20/10/21	11/10/21		1.000.000,00	
			15/10/21	12/10/21		740.000,00	
			22/10/21	12/10/21		1.500.000,00	
			25/10/21	13/10/21		2.320.000,00	
			22/10/21	14/10/21		90.000,00	
			22/10/21	15/10/21		345.000,00	
			21/10/21	18/10/21		1.280.000,00	
			21/10/21	19/10/21		2.000.000,00	
			21/10/21	19/10/21		10.000,00	
			21/10/21	20/10/21		1.005.000,00	
			25/10/21	22/10/21		725.000,00	
			01/11/21	25/10/21		1.500.000,00	
			01/11/21	25/10/21		5.000,00	
			02/11/21	25/10/21		1.560.000,00	
TPP				Toplamı:		24860000,00	

J) VADEL LEM VE OPS YON BORSASI (UZUN)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
FUTURES							
F_XU0301021			27/10/21	13/10/21	1.540,750	462.225,00	30,00
F_XU0301021			27/10/21	14/10/21	1.526,750	381.687,50	25,00
F_XU0301021			27/10/21	14/10/21	1.527,250	381.812,50	25,00
F_XU0301021			27/10/21	15/10/21	1.519,000	1.139.250,00	75,00
F_XU0301021			27/10/21	15/10/21	1.521,000	1.140.750,00	75,00
F_XU0301021			27/10/21	18/10/21	1.514,250	378.562,50	25,00
F_XU0301021			27/10/21	21/10/21	1.541,000	462.300,00	30,00
F_XU0301021			27/10/21	26/10/21	1.620,500	486.150,00	30,00
F_USDTRY1021			28/10/21	26/10/21	9,481	47.403,00	5,00
F_USDTRY1021			28/10/21	26/10/21	9,481	47.403,00	5,00
F_USDTRY1021			28/10/21	26/10/21	9,481	47.403,00	5,00
F_USDTRY1021			28/10/21	26/10/21	9,481	47.403,00	5,00
FUTURES				Toplamı:		5022349,50	335,00

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Ekim-2021

J) VADEL LEM VE OPS YON BORSASI (KISA)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
F_XU0301021			27/10/21	11/10/21	1.528,000	764.000,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	11/10/21	1.528,500	764.250,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	11/10/21	1.529,000	764.500,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	11/10/21	1.529,500	764.750,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	11/10/21	1.530,000	765.000,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	11/10/21	1.530,500	765.250,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	11/10/21	1.531,750	765.875,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	12/10/21	1.530,500	459.150,00	30,00
F_XU0301021			27/10/21	14/10/21	1.535,000	383.750,00	25,00
F_XU0301021			27/10/21	14/10/21	1.535,500	383.875,00	25,00
F_XU0301021			27/10/21	14/10/21	1.533,000	383.250,00	25,00
F_XU0301021			27/10/21	14/10/21	1.529,000	611.600,00	40,00
F_XU0301021			27/10/21	14/10/21	1.528,000	764.000,00	50,00
F_XU0301021			27/10/21	20/10/21	1.546,500	463.950,00	30,00
F_XU0301021			27/10/21	20/10/21	1.542,750	308.550,00	20,00
F_XU0301021			27/10/21	20/10/21	1.546,000	463.800,00	30,00
F_XU0301221			31/12/21	26/10/21	1.650,000	330.000,00	20,00
F_XU0301221			31/12/21	26/10/21	1.650,250	165.025,00	10,00
F_XU0301221			31/12/21	26/10/21	1.650,500	165.050,00	10,00
F_XU0301221			31/12/21	26/10/21	1.653,000	330.600,00	20,00
F_USDTRY1221			31/12/21	26/10/21	9,801	49.003,00	5,00
F_USDTRY1221			31/12/21	26/10/21	9,801	49.005,50	5,00
F_USDTRY1221			31/12/21	26/10/21	9,801	19.602,20	2,00
F_USDTRY1221			31/12/21	26/10/21	9,801	78.408,80	8,00
					Toplamı:	10762244,50	705,00
						43439994,00	2711040,00