

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Ocak-2022

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	:	1.515.060,95
E-) Katılma Payı Sayısı	:	1.275.000,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	01 Mart 2021
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,193226
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,153015
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,49
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	3,49
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	19,32
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	62,37
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,65
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	18,90
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	:	18,08
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	0,00
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,22
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	:	2,07
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (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																			
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			500,00	23,440000	11/01/22			80100517		21,600000	10.800,00	1,55	0,90	0,71
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.			TREBIMM00018			500,00	72,100000	11/01/22			80100517		70,350000	35.175,00	5,04	2,93	2,32
ENKAI	TL	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.			TREENKA00011			1.100,00	15,150000	11/01/22			80100517		15,660000	17.226,00	2,47	1,44	1,14
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			300,00	30,740000	11/01/22			80100517		27,280000	8.184,00	1,17	0,68	0,54
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			2.400,00	11,760000	11/01/22			80100518		11,910000	28.584,00	4,09	2,38	1,89
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			40.000,00	11,890000	31/01/22			80100518		11,910000	476.400,00	68,20	39,72	31,44
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			300,00	32,700000	24/01/22			80100518		32,460000	9.738,00	1,39	0,81	0,64
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMR91G7			2.200,00	11,480000	11/01/22			80100517		11,940000	26.268,00	3,76	2,19	1,73
MAVI	TL	MAVİ GİYİM SANAYİ VE			TREMAVI00037			200,00	71,550000	11/01/22			80100517		66,950000	13.390,00	1,92	1,12	0,88

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON

Ocak-2022

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	TİCARET A.Ş. MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMG100012			400,00	43,280000	11/01/22			80100517		40,820000	16.328,00	2,34	1,36	1,08
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALA RI A.Ş. TURK HAVA YOLLARI A.O.			TRASISEW91Q3			1.200,00	15,188217	21/01/22			80100518		13,800000	16.560,00	2,37	1,38	1,09
THYAO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş. TÜRK TELEKOMÜ NİKASYON A.Ş.			TRATHYAO91M5			300,00	27,044200	20/01/22			80100517		28,720000	8.616,00	1,23	0,72	0,57
TOASO	TL	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINELE RI A.S.			TRATOASO91H3			100,00	86,950000	11/01/22			80100517		79,650000	7.965,00	1,14	0,66	0,53
TTKOM	TL				TRETTLK00013			1.000,00	10,710000	11/01/22			80100517		9,580000	9.580,00	1,37	0,80	0,63
TUPRS	TL				TRATUPRS91E8			80,00	186,700000	11/01/22			80100517		171,200000	13.696,00	1,96	1,14	0,90
GRUP TOPLAMI								50.580,00								698.510,00	100,00	58,23	46,09
GRUP TOPLAMI								50.580,00								698.510,00	100,00	58,23	46,09
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Özel Sektör																			
TRSAYGZ62318	TL	AYGAZ A.Ş.	22/06/23	506	TRSAYGZ62318	9,40	4	8.534,00	100,000000	25/11/21	15,508496				102,878089	8.779,62	100,00	0,73	0,58
GRUP TOPLAMI								8.534,00								8.779,62	100,00	0,73	0,58
GRUP TOPLAMI								8.534,00								8.779,62	100,00	0,73	0,58
TPP																			
TPP			02/02/22	1		16,25		496.763,01	16,250000	25/01/22			19374	496.763,01	15,250000	496.555,72	98,03	41,40	32,77
TPP			08/02/22	7		15,80		10.034,63	15,800000	31/01/22			23621	10.034,63	15,800000	10.004,32	1,97	0,83	0,66
GRUP TOPLAMI								506.797,64								506.560,04	100,00	42,23	33,43
GRUP TOPLAMI								506.797,64								506.560,04	100,00	42,23	33,43
TPP BORÇLANMA																			
TPP BORÇLANMA																			
TPP			01/02/22	0		15,50		-205.348,22	15,500000	28/01/22			22314	-205.348,22	15,130000	-205.348,22	100,00	-17,12	-13,55
GRUP TOPLAMI								-205.348,22								-205.348,22	100,00	-17,12	-13,55
GRUP TOPLAMI								-205.348,22								-205.348,22	100,00	-17,12	-13,55
TÜREV																			
Futures																			
Kısa																			
F_GARAN0222	TL				TRVXIST02TE6			400,00	12,200000	31/01/22			80105125		12,200000	488.000,00	0,00	0,00	0,00
F_USDTRY0122	TL				TRVXIST02550			1,00	13,553200	21/12/21			80176126		13,413600	13.413,60	0,00	0,00	0,00
F_XU0300222	TL				TRVXIST02OR9			10,00	2.210,250000	31/01/22			80170126		2.239,500000	223.950,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								411,00								725.363,60	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								411,00								725.363,60	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								191.028,68								191.028,68	100,00	15,93	
GRUP TOPLAMI								191.028,68								191.028,68	100,00	15,93	
GRUP TOPLAMI								191.028,68								191.028,68	100,00	15,93	
DİĞER																			
Döviz																			
USD	USD	FED			USD			30.984,56	13,565857	31/01/22					13,401500	415.239,58	0,00	0,00	27,41
GRUP TOPLAMI								30.984,56								415.239,58	0,00	0,00	27,41
GRUP TOPLAMI								30.984,56								415.239,58	0,00	0,00	27,41
FON PORTFÖY DEĞERİ																1.199.530,12		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	1.199.530,12	79,17 %
B-)HAZIR DEĞERLER	417.170,28	27,53 %
C-)ALACAKLAR	401.000,00	26,47 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-501.616,38	-33,11 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	-1.023,07	-0,07 %
FON TOPLAM DEĞERİ	1.515.060,95	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	3.935,82	0,2598 %
Fon Yönetim Ücreti	2.101,47	0,1387 %

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Ocak-2022

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	834,04	0,0550 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1.962,89	0,1296 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	1.043,87	0,0689 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	3.508,13	0,2316 %
Diğer Harcamalar	841,57	0,0555 %
BİST KYD Ücreti	509,82	0,0337 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	79,86	0,0053 %
	14.817,47	0,9781 %

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
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

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	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
HISSE TÜRK							
ARCLK	ARÇEL K A. .			11/01/22	52,000	10.400,00	200,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.			18/01/22	27,620	662.880,00	24.000,00
SISE	TÜRK YE E VE CAM FABR KALARI A. .			19/01/22	13,960	139.600,00	10.000,00
TAVHL	TAV HAVAL MANLARI HOLD NG A. .			20/01/22	38,400	19.200,00	500,00
KCHOL	KOÇ HOLD NG A. .			20/01/22	32,880	13.152,00	400,00
ISCTR	T.I BANKASI A.S.			21/01/22	8,190	491.400,00	60.000,00
ARCLK	ARÇEL K A. .			27/01/22	49,460	9.892,00	200,00
YKBNK	YAPI VE KRED BANKASI A. .			28/01/22	4,010	401.000,00	100.000,00
HISSE TÜRK				Toplamı:		1747524,00	195300,00

IX-PORTFÖYE ALIŞLAR

A) H SSE SENETLER (ALİŞLAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
ARCLK	ARÇEL K A. .			07/01/22	51,700	20.680,00	400,00
ASELS	ASELSAN ELEKTRON K SANAY VE T CARET A. .			07/01/22	23,440	11.720,00	500,00
BIMAS	B M B RLE K MA AZALAR A. .			07/01/22	72,100	36.050,00	500,00
ENKAI	ENKA INSAAT VE SANAYI A.S.			07/01/22	15,150	16.665,00	1.100,00
EREGL	ERE L DEM R VE ÇEL K FABR KALARI T.A.			07/01/22	30,740	9.222,00	300,00
GARAN	GARANTI BANKASI			07/01/22	11,760	28.224,00	2.400,00
KCHOL	KOÇ HOLD NG A. .			07/01/22	32,700	22.890,00	700,00
KRDMD	KARDEM R KARABÜK DEM R ÇEL K SANAY VE T CARET A. . (D)			07/01/22	11,480	25.256,00	2.200,00

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Ocak-2022

MAVI	MAV G Y M SANAY VE T CARET A. .	07/01/22	71,550	14.310,00	200,00
MGROS	M GROS T CARET A. .	07/01/22	43,280	17.312,00	400,00
SISE	TÜRK YE E VE CAM FABR KALARI A. .	07/01/22	14,840	17.808,00	1.200,00
TAVHL	TAV HAVAL MANLARI HOLD NG A. .	07/01/22	37,360	18.680,00	500,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	07/01/22	24,980	7.494,00	300,00
TOASO	TOFA TÜRK OTOMOB L FABR KASI A. .	07/01/22	86,950	8.695,00	100,00
TTKOM	TÜRK TELEKOMÜN KASY ON A. .	07/01/22	10,710	10.710,00	1.000,00
TUPRS	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINELERİ A.S.	07/01/22	186,700	14.936,00	80,00
YKBNK	YAPI VE KRED BANKASI A. .	10/01/22	3,780	75.600,00	20.000,00
SISE	TÜRK YE E VE CAM FABR KALARI A. .	10/01/22	15,230	152.300,00	10.000,00
YKBNK	YAPI VE KRED BANKASI A. .	10/01/22	3,740	74.800,00	20.000,00
YKBNK	YAPI VE KRED BANKASI A. .	10/01/22	3,760	225.600,00	60.000,00
ISCTR	T.I BANKASI A.S.	10/01/22	7,890	78.900,00	10.000,00
ISCTR	T.I BANKASI A.S.	11/01/22	7,740	387.000,00	50.000,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	11/01/22	27,060	541.200,00	20.000,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	11/01/22	27,120	108.480,00	4.000,00
GARAN	GARANTI BANKASI	31/01/22	11,890	475.600,00	40.000,00
Toplamı:				2400132,00	245880,00

E) DÖV Z (ALİ LAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
DÖVİZ							
USD	FED			28/01/22	13,623	408.690,00	30.000,00
Toplamı:						408690,00	30000,00

I) TAKASBANK PARA P YASASI

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
TPP							
			07/01/22	05/01/22		1.335.000,00	
			11/01/22	07/01/22		1.335.000,00	
			12/01/22	11/01/22		906.000,00	
			13/01/22	12/01/22		300.000,00	
			28/01/22	21/01/22		75.000,00	
			28/01/22	24/01/22		30.000,00	
			02/02/22	25/01/22		495.000,00	
			08/02/22	31/01/22		10.000,00	
Toplamı:						4486000,00	

J) VADEL LEM VE OPS YON BORSASI (UZUN)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
FUTURES							
F_XU0300222			28/02/22	04/01/22	2.241,000	67.230,00	3,00
F_THYAO0122			31/01/22	18/01/22	27,820	653.770,00	235,00
F_THYAO0122			31/01/22	18/01/22	27,810	13.905,00	5,00
F_SISE0122			31/01/22	19/01/22	14,050	140.500,00	100,00

TMR-TEB PORTFÖY MAKRO SERBEST FON
Ocak-2022

F_XU0300222	28/02/22	20/01/22	2.271,000	90.840,00	4,00
F_ISCTR0122	31/01/22	21/01/22	8,230	493.800,00	600,00
F_XU0300222	28/02/22	21/01/22	2.258,000	90.320,00	4,00
F_XU0300222	28/02/22	24/01/22	2.143,250	42.865,00	2,00
F_XU0300222	28/02/22	24/01/22	2.143,500	21.435,00	1,00
F_XU0300222	28/02/22	24/01/22	2.159,000	64.770,00	3,00
F_XU0300222	28/02/22	25/01/22	2.128,000	63.840,00	3,00
F_XU0300222	28/02/22	27/01/22	2.220,750	133.245,00	6,00
F_XU0300222	28/02/22	27/01/22	2.226,000	133.560,00	6,00
F_YKBNK0122	31/01/22	28/01/22	4,010	401.000,00	1.000,00
FUTURES			Toplamı:	2411080,00	1972,00

J) VADEL LEM VE OPS YON BORSASI (KISA)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHI	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
F_XU0300222			28/02/22	05/01/22	2.321,000	116.050,00	5,00
F_XU0300222			28/02/22	07/01/22	2.348,250	117.412,50	5,00
F_XU0300222			28/02/22	07/01/22	2.367,000	142.020,00	6,00
F_XU0300222			28/02/22	07/01/22	2.363,000	141.780,00	6,00
F_YKBNK0122			31/01/22	10/01/22	3,870	77.400,00	200,00
F_SISE0122			31/01/22	10/01/22	15,590	155.900,00	100,00
F_YKBNK0122			31/01/22	10/01/22	3,830	76.600,00	200,00
F_YKBNK0122			31/01/22	10/01/22	3,850	231.000,00	600,00
F_ISCTR0122			31/01/22	10/01/22	8,080	80.800,00	100,00
F_ISCTR0122			31/01/22	11/01/22	7,900	395.000,00	500,00
F_THYAO0122			31/01/22	11/01/22	27,610	552.200,00	200,00
F_THYAO0122			31/01/22	11/01/22	27,700	110.800,00	40,00
F_XU0300222			28/02/22	20/01/22	2.338,250	46.765,00	2,00
F_XU0300222			28/02/22	20/01/22	2.338,000	23.380,00	1,00
F_XU0300222			28/02/22	25/01/22	2.187,250	262.470,00	12,00
F_XU0300222			28/02/22	26/01/22	2.194,000	131.640,00	6,00
F_GARAN0222			28/02/22	31/01/22	12,170	486.800,00	400,00
F_XU0300222			28/02/22	31/01/22	2.243,250	134.595,00	6,00
					Toplamı:	3282612,50	2389,00
						14736038,50	475541,00