

TEB Portföy Dördüncü Değişken Fon
Temmuz 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy Dördüncü Değişken Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	105,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	3,237,673.54
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	115,901,991.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	01/10/2004
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.027935
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.027973
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.14%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	7.50%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	6.86%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	21.61%
Varant	
Devlet Tahvili	39.41%
Özel Sektör Tahvili	8.49%
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	0.14%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	14.53%
Kıymetli Madenler	6.95%
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	
Yabancı Sabit Getirili	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	8.87%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	1.08%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	42.80%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,660.94
J. AYLIK KORELASYON :	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :	
L. AYLIK TAKİP HATASI :	
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :	
N. AYLIK TAKİP FARKI :	
O. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI :	
P. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :	
R. GEÇEN AYKİ TAKİP FARKI :	
S. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	449,772.68
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	993,004.03

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	5,550.00	42,735.00	1.33%
AKCNS	1,050.00	13,975.50	0.43%
AKSA	350	2,726.50	0.08%

ALKIM	460	6,131.80	0.19%
ASELS	2,465.00	23,294.25	0.72%
BIMAS	385	21,252.00	0.66%
CIMSA	1,225.00	18,362.75	0.57%
DEVA	2,525.00	8,635.50	0.27%
EKGYO	10,525.00	28,101.75	0.87%
ENKAI	2,435.00	10,714.00	0.33%
EREGL	4,965.00	22,541.10	0.70%
GARAN	7,990.00	58,566.70	1.82%
HALKB	2,725.00	21,418.50	0.67%
INDES	1,825.00	15,147.50	0.47%
ISCTR	5,825.00	26,795.00	0.83%
IST30	4,650.00	168,590.40	5.24%
KCHOL	815	10,432.00	0.32%
MGROS	770	12,504.80	0.39%
SAHOL	4,800.00	42,768.00	1.33%
SODA	6,249.99	25,562.46	0.79%
TAVHL	950	10,393.00	0.32%
TCELL	1,475.00	15,281.00	0.47%
THYAO	4,000.00	20,680.00	0.64%
TOASO	1,075.00	25,370.00	0.79%
TTKOM	3,650.00	22,046.00	0.68%
TTRAK	130	10,842.00	0.34%
TUKAS	6,975.00	9,137.25	0.28%
TUPRS	670	42,779.50	1.33%
YKBNK	8,750.00	30,187.50	0.94%
TOPLAM :	95,259.99	766,971.76	23.82%

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

TRT050220T17	20,000.00	19,605.82	0.61%
TRT100719T18	22,000.00	21,697.10	0.67%
TRT110226T13	200,000.00	222,450.65	6.91%
TRT120122T17	14,000.00	14,059.58	0.44%
TRT140922T17	464,000.00	456,874.32	14.19%
TRT141118T19	20,000.00	20,215.90	0.63%
TRT230222T13	77,000.00	110,857.94	3.44%
TRT240724T15	300,000.00	304,475.67	9.46%
TRT270319T13	12,000.00	12,778.23	0.40%
TOPLAM :	1,129,000.00	1,183,015.22	36.74%

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

TRSKCTF81714	100,000.00	105,322.53	3.27%
TRSKRSNE1713	100,000.00	100,457.78	3.12%
TRSYKFK41810	100,000.00	100,235.57	3.11%
TOPLAM :	300,000.00	306,015.87	9.50%

G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:

H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:

I) KİRA SERTİFİKALARI:

J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:

K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:

L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:

XGOLD_0995	2	256,989.45	7.98%
TOPLAM :	2	256,989.45	7.98%

M) KATILIM HESAPLARI:

N) KATILMA BELGELERİ:

O) VOB İŞLEMLERİ:

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:

S) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:

VL Vadeli Mevduat TL	79,561.82	78,671.30	2.44%
VL Vadeli Mevduat TL	89,256.48	88,574.60	2.75%
VL Vadeli Mevduat TL	95,775.93	94,869.89	2.95%
VL Vadeli Mevduat TL	23,987.96	23,727.43	0.74%
BPP	100,996.71	100,531.18	3.12%
BPP	101,104.93	100,337.77	3.12%
BPP	220,181.73	220,181.73	6.84%
TOPLAM :	710,865.56	706,893.90	21.95%

FON PORTFÖY DEĞERİ	2,235,127.55	3,219,886.19
--------------------	--------------	--------------

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	3,219,886.19	99.45%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	30,705.89	0.95%
C. ALACAKLAR (+) :	0	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	1,291.82	0.04%
E. BORÇLAR (-) :	14,210.36	0.44%
FON TOPLAM DEĞERİ:	3,237,673.54	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	7,000.81
37002Denetim Ücreti	373.55
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	11.28
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	1.47
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	172.75
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	55.97
37045Fon Saklama Ücreti	124.47
37099Diğer Giderler	527.62
TOPLAM	8,267.92