

TEB Portföy Birinci Değişken Fon
Temmuz 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy Birinci Değişken Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	400,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	4,880,053.19
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	1,659,523.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/11/1995
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	2.940636
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	2.990698
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-1.67%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	6.04%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	3.12%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	37.94%
Varant	
Devlet Tahvili	34.44%
Özel Sektör Tahvili	14.91%
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	3.15%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	1.86%
Yabancı Sabit Getiriliiler	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	7.70%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	4.15%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	48.11%
Devlet Borçlanma Senetleri	17.12%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,428.80
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:	300,940.16
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	426,197.67

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

Nominal Değeri

Rayiç Değeri

%

A) HİSSE SENETLERİ

AKBNK	21,350.00	164,395.00	3.37%
AKCNS	5,600.00	74,536.00	1.53%
ASELS	3,900.00	36,855.00	0.75%
AYGAZ	3,350.00	37,654.00	0.77%
CIMSA	5,100.00	76,449.00	1.57%
DGATE	1,150.00	18,699.00	0.38%
ENKAI	8,400.00	36,960.00	0.76%
EREGL	12,650.00	57,431.00	1.18%
FROTO	2,950.00	95,993.00	1.97%
GARAN	25,000.00	183,250.00	3.75%
GUBRF	6,850.00	37,264.00	0.76%
INDES	7,000.00	58,100.00	1.19%
ISCTR	20,600.00	94,760.00	1.94%
KCHOL	7,500.00	96,000.00	1.97%
SAHOL	8,550.00	76,180.50	1.56%
SODA	27,750.81	113,500.81	2.32%
TATGD	10,950.00	56,392.50	1.15%
TAVHL	8,200.00	89,708.00	1.84%
TBORG	6,900.00	40,020.00	0.82%
TOASO	1,600.00	37,760.00	0.77%
TRGYO	3,850.00	17,787.00	0.36%
TTRAK	470	39,198.00	0.80%
TUPRS	2,600.00	166,010.00	3.40%
ULKER	4,700.00	92,919.00	1.90%
YKBNK	21,250.00	73,312.50	1.50%
TOPLAM :	228,220.81	1,871,134.31	38.32%

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

TRT140218T10	500,000.00	496,741.99	10.17%
TRT170221T12	300,000.00	328,283.22	6.72%
TRT200324T13	500,000.00	541,199.53	11.08%
TRT240724T15	300,000.00	304,475.67	6.24%
TOPLAM :	1,600,000.00	1,670,700.41	34.21%

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

TRISISGY61912	110,000.00	111,028.89	2.27%
TRSKTMR51711	100,000.00	103,271.12	2.11%
TRSLBTV61812	150,000.00	153,160.42	3.14%
TRSORFN21812	200,000.00	202,165.53	4.14%
TRSYDATA1711	100,000.00	101,625.63	2.08%
TRSYKFK41810	100,000.00	100,235.57	2.05%
TOPLAM :	760,000.00	771,487.16	15.80%

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:

M) KATILIM HESAPLARI:

N) KATILMA BELGELERİ:

O) VOB İŞLEMLERİ:

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	85,286.78	85,286.78	1.75%
TOPLAM :	85,286.78	85,286.78	1.75%

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	104,634.17	103,463.04	2.12%
VL Vadeli Mevduat TL	103,970.83	103,176.55	2.11%
VL Vadeli Mevduat TL	105,742.82	104,742.46	2.15%
VL Vadeli Mevduat TL	23,243.39	22,990.95	0.47%
RRP TRT161116T19	150,086.92	150,086.92	3.07%
TOPLAM :	487,678.13	484,459.92	9.92%

FON PORTFÖY DEĞERİ	3,161,185.72	4,883,068.59
--------------------	--------------	--------------

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	4,883,068.59	100.06%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	13,987.92	0.29%
C. ALACAKLAR (+) :	685	0.01%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	1,291.82	0.03%
E. BORÇLAR (-) :	18,980.14	0.39%

FON TOPLAM DEĞERİ:	4,880,053.19
--------------------	--------------

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	12,997.01
37002Denetim Ücreti	575.05
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	4.71
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	30.88
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	20.03
37004Aracılık Komisyonu	469.83
37006Saklama Giderleri	84.63
37023VOB İşlemi Komisyonu	88
37045Fon Saklama Ücreti	171.03
37099Diğer Giderler	557.38
TOPLAM	14,998.55