

TEB Portföy Alarko Grubu Değişken Özel Fon
Temmuz 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy Alarko Grubu Değişken Özel Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	6,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	93,685,493.37
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	78,700,000.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	24/07/2000
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	1.190413
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.184658
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.49%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	6.60%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	7.62%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	25.14%
Varant	
Devlet Tahvili	53.94%
Özel Sektör Tahvili	
Finansman Bonosu	5.23%
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	3.01%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	1.69%
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	2.34%
Yabancı Sabit Getiriler	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	8.64%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	13.12%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	82.17%
Devlet Borçlanma Senetleri	95.96%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	321.52
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:	0
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	0

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

Nominal Değeri	Rayıç Değeri	%
----------------	--------------	---

A) HİSSE SENETLERİ

AKBNK	290,000.00	2,233,000.00	2.38%
AKCNS	60,000.00	798,600.00	0.85%
ASELS	122,500.00	1,157,625.00	1.23%
BIMAS	20,000.00	1,104,000.00	1.18%
CIMSA	60,000.00	899,400.00	0.96%
DGATE	27,500.00	447,150.00	0.48%
EKGYO	327,500.00	874,425.00	0.93%
ENKAI	150,000.00	660,000.00	0.70%
EREGL	170,000.00	771,800.00	0.82%
GARAN	460,000.00	3,371,800.00	3.60%
INDES	57,500.00	477,250.00	0.51%
ISCTR	95,000.00	437,000.00	0.47%
KCHOL	82,500.00	1,056,000.00	1.13%
SAHOL	135,000.00	1,202,850.00	1.28%
SODA	290,000.08	1,186,100.33	1.27%
TATGD	165,000.00	849,750.00	0.91%
TAVHL	40,000.00	437,600.00	0.47%
THYAO	87,500.00	452,375.00	0.48%
TOASO	55,000.00	1,298,000.00	1.38%
TTRAK	4,000.00	333,600.00	0.36%
TUPRS	25,000.00	1,596,250.00	1.70%
YKBNK	405,000.00	1,397,250.00	1.49%
TOPLAM :	3,129,000.08	23,041,825.33	24.58%

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

TRT080317T18	10,000,000.00	10,368,060.70	11.06%
TRT140218T10	12,500,000.00	12,418,549.75	13.25%
TRT140617T17	30,000,000.00	30,528,989.70	32.56%
TOPLAM :	52,500,000.00	53,315,600.15	56.87%

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

TRFAKYM91611	5,000,000.00	4,925,950.95	5.25%
TOPLAM :	5,000,000.00	4,925,950.95	5.25%

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

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:

F_TRYUSD0816S0	5,750.00	3.01	0.00%
F_XU0300816S0	525	93.33	0.00%
TOPLAM :	6,275.00	96.34	0.00%

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:

TL	2,329,439.80	2,329,439.80	2.48%
TOPLAM :	2,329,439.80	2,329,439.80	2.48%

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	2,284,224.19	2,258,657.73	2.41%
VL Vadeli Mevduat TL	2,291,477.82	2,273,971.77	2.43%
VL Vadeli Mevduat TL	2,338,423.21	2,316,301.43	2.47%
VL Vadeli Mevduat TL	1,304,681.76	1,290,511.82	1.38%
RRP TRT111120T18	1,000,675.62	1,000,675.62	1.07%
RRP TRT170221T12	1,000,675.62	1,000,675.62	1.07%
TOPLAM :	10,220,158.22	10,140,793.99	10.82%
FON PORTFÖY DEĞERİ	73,178,598.10	93,753,610.22	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	93,753,610.22	100.07%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	21,501.40	0.02%
C. ALACAKLAR (+) :	0.01	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	1,291.82	0.00%
E. BORÇLAR (-) :	90,910.07	0.10%
FON TOPLAM DEĞERİ:	93,685,493.37	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	79,814.82
37002Denetim Ücreti	575.05
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	799.68
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	451.29
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	551.12
37004Aracılık Komisyonu	11,433.38
37006Saklama Giderleri	877.61
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	893.03
37023VOB İşlemi Komisyonu	1,891.84
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	1,018.36
37045Fon Saklama Ücreti	3,192.45
37099Diğer Giderler	1,115.69
TOPLAM	102,614.32