

TEB Portföy Birinci Değişken Fon
Ekim 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:	4,339,475.63
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	1,446,456.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/11/1995
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	3.000074
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	2.977734
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.75%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	8.19%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.90%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	35.21%
Varant	
Devlet Tahvili	28.04%
Özel Sektör Tahvili	19.76%
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	6.10%
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	1.97%
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	8.92%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	3.63%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	40.78%
Devlet Borçlanma Senetleri	0.00%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,065.49
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:	13,083.42
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	145,847.17

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	14,950.00	123,636.50	2.82%
AKCNS	3,650.00	47,085.00	1.08%
ARCLK	10	204.4	0.00%

ARCLK	165	3,372.60	0.08%
ARCLK	225	4,599.00	0.11%
ASELS	6,500.00	61,100.00	1.40%
AYGAZ	2,850.00	31,122.00	0.71%
BIMAS	1,205.00	60,732.00	1.39%
BIMAS	118	5,947.20	0.14%
BIMAS	187	9,424.80	0.22%
CCOLA	400	14,000.00	0.32%
CIMSA	4,050.00	62,248.50	1.42%
DEVA	1,900.00	8,037.00	0.18%
DGATE	900	3,807.00	0.09%
ENKAI	10,400.00	49,088.00	1.12%
EREGL	14,250.00	59,850.00	1.37%
FROTO	1,950.00	61,698.00	1.41%
GARAN	22,100.00	185,861.00	4.25%
INDES	8,450.00	62,614.50	1.43%
ISCTR	12,800.00	64,256.00	1.47%
KCHOL	3,550.00	45,795.00	1.05%
MGROS	0.00	0.00	0.00%
SAHOL	11,500.00	107,525.00	2.46%
SODA	21,700.81	93,313.48	2.13%
SODA	1,550.00	6,665.00	0.15%
TATGD	5,100.00	29,070.00	0.66%
TBORG	2,300.00	15,182.30	0.35%
TCELL	4,550.00	45,363.50	1.04%
TCELL	1,550.00	15,453.50	0.35%
TOASO	2,700.00	62,910.00	1.44%
TTKOM	7,825.00	44,759.00	1.02%
TUPRS	1,240.00	78,182.00	1.79%
ULKER	800	15,360.00	0.35%
YATAS	1,800.00	7,704.00	0.18%
YKBNK	16,400.00	60,680.00	1.39%
TOPLAM :	189,625.81	1,546,646.28	35.33%

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

TRT140218T10	400,000.00	392,618.21	8.97%
TRT170221T12	300,000.00	317,520.72	7.25%
TRT200324T13	500,000.00	520,601.69	11.89%
TOPLAM :	1,200,000.00	1,230,740.61	28.11%

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

TRISGY61912	110,000.00	111,049.23	2.54%
TRSKRSNE1713	100,000.00	100,804.90	2.30%
TRSKTMR51711	100,000.00	103,213.58	2.36%
TRSLBTV61812	150,000.00	152,973.73	3.49%
TRSORFN21812	200,000.00	202,250.33	4.62%
TRSYDATA1711	100,000.00	101,811.32	2.33%
TRSYKFK41810	100,000.00	100,095.18	2.29%
TOPLAM :	860,000.00	872,198.26	19.92%

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	86,965.57	86,965.57	1.99%
TOPLAM :	86,965.57	86,965.57	1.99%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	92,991.31	92,032.58	2.10%
VL Vadeli Mevduat TL	93,435.08	92,674.87	2.12%
VL Vadeli Mevduat TL	92,443.06	91,428.32	2.09%
VL Vadeli Mevduat TL	95,932.64	95,044.69	2.17%
RRP TRT161116T19	270,048.82	270,048.82	6.17%
TOPLAM :	644,850.91	641,229.28	14.65%
FON PORTFÖY DEĞERİ	2,981,442.29	4,377,780.01	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	4,377,780.01	100.88%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	10,137.94	0.23%
C. ALACAKLAR (+) :	192,480.34	4.44%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	508.9	0.01%
E. BORÇLAR (-) :	241,431.56	5.56%
FON TOPLAM DEĞERİ:	4,339,475.63	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	10,670.63
37002Denetim Ücreti	537.95
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	68.15
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	25.71
37004Aracılık Komisyonu	324.64
37006Saklama Giderleri	79.17
37045Fon Saklama Ücreti	140.19
37099Diğer Giderler	521.42
TOPLAM	12,367.86