

TEB Portföy ÖPY Yıldız Bankacılık Müşterileri Değişken Özel Fon
Mart 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy ÖPY Yıldız Bankacılık Müşterileri Değişken Özel Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	27,500,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	12,503,241.14
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	405,685,742.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	22/09/2004
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.03082
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.03055
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.88%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	2.26%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	8.99%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	3.50%
Varant	
Devlet Tahvili	64.23%
Özel Sektör Tahvili	0.52%
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	5.00%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	18.73%
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	2.54%
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	5.48%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	15.69%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	325.03%
Devlet Borçlanma Senetleri	15.20%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	220.744
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:	1,841,794.01

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT080317T18	4,000,000.00	3,992,455.08	31.93%
TRT130716T18	1,000,000.00	1,012,938.70	8.10%
TRT161116T19	2,400,000.00	2,448,672.17	19.58%
TRT161116T19	800,000.00	816,224.06	6.53%
TOPLAM :	8,200,000.00	8,270,290.00	66.14%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSM LPC91814	300,000.00	302,098.52	2.42%
TOPLAM :	300,000.00	302,098.52	2.42%
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_XU0300416S0	-88	101.97	0.00%
TOPLAM :	-88	101.98	0.00%
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	305,023.16	305,023.16	2.44%
TOPLAM :	305,023.16	305,023.16	2.44%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	216,270.97	214,319.35	1.71%
VL Vadeli Mevduat TL	209,562.87	208,251.01	1.67%
VL Vadeli Mevduat TL	202,369.40	201,033.18	1.61%
VL Vadeli Mevduat TL	202,562.84	200,728.91	1.61%
RRP TRT230222T13	400,104.11	400,104.11	3.20%
BPP	1,010,087.67	1,006,121.57	8.05%
BPP	1,007,926.03	1,006,265.82	8.05%
BPP	390,137.84	390,137.84	3.12%
TOPLAM :	3,639,021.73	3,626,961.79	29.01%
FON PORTFÖY DEĞERİ	12,444,044.89	12,504,373.48	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	12,504,373.48	100.01%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	17,793.14	0.14%

C. ALACAKLAR (+) :	0	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	2,330.04	0.02%
E. BORÇLAR (-) :	21,255.52	0.17%

FON TOPLAM DEĞERİ: 12,503,241.14

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	17,063.42
37002Denetim Ücreti	575.05
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	27.03
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	180.59
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	75.6
37004Aracılık Komisyonu	478.31
37006Saklama Giderleri	219.48
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	462.72
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	625.19
37023VOB İşlemi Komisyonu	157.66
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	299.49
37045Fon Saklama Ücreti	456.13
37099Diğer Giderler	597.51
TOPLAM	21,218.18