

TACİRLER PORTFÖY DEĞİŞKEN FON

Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer / Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

Tacirler Portföy Değişken Fon'unun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer / net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına İlişkin Tebliğ (II-14.2) ("Tebliğ") hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını SPK'nın konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Tacirler Portföy Değişken Fon'unun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer / net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları Tebliğ hükümlerine ve SPK tarafından belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen SPK, Kurucu Yönetim Kurulu ve Tacirler Portföy Yönetimi A.Ş.'nin ("Kurucu") bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
Member of DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED



Zere Gaye Şentürk, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 29 Nisan 2021

TACİRLER PORTFÖY DEĞİŞKEN FON
31 ARALIK 2020 TARİHLİ
FON TOPLAM DEĞER TABLOSU

	<u>TUTAR (TL)</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	710.498.830,91		103,67	<u>FON TOPLAM DEĞERİ</u>	685.329.575,59
B. HAZİR DEĞERLER	2.386.338,36		0,35	Toplam Pay Sayısı	500.000.000,000
a) Kasa	0,00	0,00	0,00	Dolaşımdaki Pay	155.897.901,000
b) Bankalar	13.045,89	0,55	0,00	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	344.102.099,000
c) Diğer Hazır Değerler	2.373.292,47	99,45	0,35		
C. ALACAKLAR	50.245.932,13		7,33	Dolaşımdaki Pay Oranı	% 31,18
a) Takastan Alacaklar Toplamı	50.166.973,11	100,00	7,32	<u>BİRİM PAY DEĞERİ</u>	4.396015
i) T1 Alacakları	0,00		0,00	Günlük Vergi	
ii) T2 Alacakları	43.663.576,41		0,00	Günlük Yönetim Ücreti	0,00
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	6.503.396,70		0,00	Bir Gün Önceki Fiyat	4,382248
b) Diğer Alacaklar	78.959,02		0,01	Bir Gün Önceki Vergi	0,00
i) Diğer Alacaklar	12.896,92		0,00	Getiri (%)	0,314150
ii) Vergi Alacakları	0,00		0,00		
iii) Mevduat Alacakları	0,00		0,00		
iv) Temettu	66.062,10		0,01		
	<u>TUTAR</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>	USD TCMB ALIS KURU	7,4194
D. BORÇLAR	-77.801.525,81		-11,35	EURO TCMB ALIS KURU	9,1164
a) Takasa Borçlar	-74.284.382,66	95,48	-10,84		
i) T1 Borçları	0,00				
ii) T2 Borçları	-64.439.502,19				
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-9.844.880,47				
iv) İhbarlı FonPay Takas	-2.554.561,36				
b) Yönetim Ücreti	-755.233,45	0,97	-0,11		
c) Ödenecek Vergi	0,00	0,00	0,00		
d) İhtiyatlar	0,00	0,00	0,00		
e) DİĞER BORÇLAR	-173.081,86	0,27	-0,03		
i) Diğer Borçlar	-148.925,86		-0,02		
ii) Denetim Reeskontu	-24.156,00		0,00		
f) Kayda Alma Ücreti	-34.266,48		0,04		
g) Krediler	0,00		0,00		

Özel Sektör Tahvil														
TRSTPRS22114	TL	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	05/02/21	0,00	150.000,00	102,386400	29/12/20	18,654137	7372231047705	102,530593	153.795,89	3,41	0,02	0,02
TRSARCL22117	TL	ARÇELİK A.Ş.	12/02/21	0,00	400.000,00	101,720100	17/12/20	15,969009	7367439925781	102,481448	409.925,79	9,09	0,06	0,06
TRSOPAS22129	TL	OPET PETROLÇÜLÜK A.Ş.	19/02/21	0,00	90.000,00	101,754800	29/12/20	18,786488	7372231047705	101,898737	91.708,86	2,03	0,01	0,01
TRSERGLS2117	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.	28/05/21	0,00	250.000,00	101,058900	29/12/20	17,809305	7372231047705	101,604223	254.010,56	5,63	0,04	0,04
TRSKALE62114	TL	KALESERAMİK ÇANAKKALE KALEBODUR	17/06/21	0,00	500.000,00	100,251600	30/12/20	18,886223	7372231047706	100,718325	503.591,62	11,16	0,07	0,07
TRSORFN2112	TL	ORFİN FİNANSMAN	27/07/21	0,00	450.000,00	96,926000	29/12/20	9,840389	7372231047705	101,998850	458.994,83	10,17	0,07	0,07
TRSDVA42219	TL	DEVA HOLDİNG A.Ş.	29/04/22	0,00	450.000,00	101,754200	29/12/20	17,464030	7372231047705	102,641359	461.886,11	10,24	0,07	0,07
TRSYAZI52216	TL	AG ANADOLU GRUBU HOLDİNG	11/05/22	0,00	350.000,00	101,112000	29/12/20	16,479884	7372231047706	102,174670	357.611,35	7,93	0,05	0,05
TRSMGT162228	TL	MIGROS TİCARET A.Ş.	08/06/22	0,00	470.000,00	101,921400	29/12/20	15,326524	7372231047706	100,908412	474.269,54	10,51	0,07	0,07
TRFANLZ31917	TL	ANALİZ FACTORİNG	15/03/29	120,00	110.000,00	0,000000	20/12/19	0,000000		100,000000	110.000,00	2,44	0,01	0,02
TRFANLZ31917	TL	ANALİZ FACTORİNG (Değer Düşüklüğü Karşılığı-	15/03/29	120,00	120.000,00	0,000000	20/12/19	0,000000		100,000000	-110.000,00	-2,44	-0,02	-0,02
GRUP TOPLAMI					4.430.000,00						4.361.557,51	96,68	0,61	0,63
İleri Valörlü Alışlar Türk														
Özel Sektör														
TRFTİSB12129	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.	07/01/21	0,00	150.000,00	99,852273	04/01/21		7372984213172	99,895610	149.843,42	3,32	0,02	0,02
GRUP TOPLAMI					150.000,00						149.843,42	3,32	0,02	0,02
GRUP TOPLAMI					4.690.000,00						4.511.400,93	100,00	0,63	0,65
DİĞER														
Y.Fonu Türk														
TÖB-TACİRLER KISA VAD. BORÇ.	TL	TACİRLER PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			#####	0,043310	28/07/20			0,044828	1.293.812,02	65,86	0,18	0,19
TFP-TACİRLER	TL	TACİRLER PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			306.547,00	2,093210	31/12/20			2,187468	670.561,75	34,14	0,09	0,10
GRUP TOPLAMI					29.168.241,00						1.964.373,77	100,00	0,27	0,29
GRUP TOPLAMI					29.168.241,00						1.964.373,77	100,00	0,27	0,29
TÜREV														
Futures														
Uzun														
F_EKGYO0121	TL				125.000,00	2,210000	29/12/20		8010512522350	2,180000	27.250.000,00	0,00	0,00	0,00
F_KRDM0121	TL				50.000,00	5,840000	28/12/20		8010512522263	5,860000	29.300.000,00	0,00	0,00	0,00
F_PETKM0121N1	TL				50.000,00	5,160000	30/12/20		8010512522437	5,090000	30.540.000,00	0,00	0,00	0,00
F_SISE0121	TL				20.000,00	7,420000	30/12/20		8010512522439	7,450000	14.900.000,00	0,00	0,00	0,00
F_TCELL0121	TL				10.000,00	16,500000	17/12/20		8010512521667	16,390000	16.390.000,00	0,00	0,00	0,00
F_THYAO0121	TL				20.000,00	13,120000	29/12/20		8010512522342	13,160000	26.320.000,00	0,00	0,00	0,00
Kısa														
F_TUPRS0121	TL				2.750,00	110,200000	30/12/20		8010512522466	110,180000	30.299.500,00	0,00	0,00	0,00
Uzun														
F_VAKBN0121	TL				50.000,00	4,860000	28/12/20		8010512522272	4,800000	24.000.000,00	0,00	0,00	0,00
F_XU0301220	TL				3.250,00	1.642,750000	31/12/20		8017012619819	#####	53.389.375,00	0,00	0,00	0,00
Kısa														
F_YKBNK0121	TL				50.000,00	3,140000	24/12/20		8010512522101	3,140000	15.700.000,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI					381.000,00						268.078.875,00	0,00	0,00	0,00
Option														
Call Alım														
O_XU030E0221C1520.00	TL		26/02/21		37,00	77,035,518919	11/12/20			172,810000	63.939,70	48,82	0,01	0,01
O_XU030E0221C1640.00	TL		26/02/21		38,00	31.177,381579	11/12/20			73,400000	27.892,00	21,29	0,00	0,00
O_XU030E0221C1660.00	TL		26/02/21		63,00	26.725,539683	11/12/20			62,140000	39.148,20	29,89	0,01	0,01
GRUP TOPLAMI					138,00						130.979,90	100,00	0,02	0,02
GRUP TOPLAMI					381.138,00						268.209.854,90	100,00	0,02	0,02
VIOP Nakit Teminatı														
VIOP Nakit Teminatı											85.885.963,92	100,00	12,53	
GRUP TOPLAMI					85.885.963,92						85.885.963,92	100,00	12,53	
GRUP TOPLAMI					85.885.963,92						85.885.963,92	100,00	12,53	
DİĞER														
Döviz														
CHF	CHF				0,70	6,967096	31/12/20			8,401700	5,87	0,00	0,00	0,00
USD	USD	FED			319,875,86	7,654820	31/12/20			7,419400	2.373.286,93	0,00	0,00	0,35
GRUP TOPLAMI					319.876,55						2.373.292,80	0,00	0,00	0,35
GRUP TOPLAMI					319.876,55						2.373.292,80	0,00	0,00	0,35
FON PORTFÖY DEĞERİ										710.498.830,91		100,44		