

[Aralık Ayı İçin Tıklayınız.](#)

A TİPİ İMKB ULUSAL-30 ENDEKS FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON) (809-TİE)
01.01.2013-31.01.2013 DÖNEMİ AYLIK RAPORU

I. FONU TANITICI BİLGİLER

a) Fonun Adı	A TİPİ İMKB ULUSAL-30 ENDEKS FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON) (809-TİE)
b) Kurucunun Ünvanı	T. İŞ BANKASI A.Ş.
c) Yöneticinin Ünvanı	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
d) Fon Tutarı	50.000.000,00
e) Fon Toplam Değeri	48.068.089,96
f) Tedavüldeki Pay Sayısı	1.247.351.982,00
g) Fonun Kuruluş Tarihi	10.03.2000
h) Fonun Süresi	Süresizdir

II. FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

a) Ay Sonu Pay Fiyatı	0,038536
b) Önceki Ay Pay Fiyatı	0,038510
c) Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	0,07
d) Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	0,07
e) Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	38,71
f) Aylık Ort.Portföydeki M.K. Yüzdesi	100,00
g) Aylık Ort.Tedavül Oranı	23,79
h) Aylık Ort.Portföy Devir Hızı	5,06
i) Portföyün Ortalama vadesi	0,97

III. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

A) HİSSE SENETLERİ

1. Banka İştirak ve Hissedarları

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
SİSE		154.519,433	474.374,66	0,98
TSKB		1,465	3,33	0,00
TOPLAM		154.520,90	474.377,99	0,98

2. Diğer Ortaklıklar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
BIMAS		29.366,000	2.503.451,50	5,19
MGROS		12.003,000	243.660,90	0,50
ENKAI		112.874,228	595.975,92	1,23
TUPRS		41.556,000	2.015.466,00	4,18
AKBNK		542.424,654	4.827.579,42	10,00
KCHOL		189.297,370	1.737.749,86	3,60
GARAN		710.759,000	6.268.894,38	12,99
TOASO		41.816,000	443.249,60	0,92
SAHOL		289.256,994	2.935.958,49	6,08
ARCLK		60.113,000	691.299,50	1,43
EREGL		320.888,697	802.221,74	1,66
ISCTR		490.442,761	3.187.877,95	6,60
PETKM		141.502,203	434.411,76	0,90
DOHOL		235.594,594	254.442,16	0,53
YKBNK		264.531,000	1.364.979,96	2,83
TCELL		182.364,000	1.996.885,80	4,14
ASELS		23.150,000	188.904,00	0,39
IHLAS		161.570,000	192.268,30	0,40
VAKBN		216.619,000	1.113.421,66	2,31
SKBNK		0,166	0,31	0,00
TTRAK		4.142,000	205.029,00	0,42
THYAO		212.992,249	1.392.969,31	2,89
ASYAB		154.811,000	345.228,53	0,72
TAVHL		0,500	5,48	0,00
HALKB		247.866,000	4.312.868,40	8,94
KRDMD		193.081,769	305.069,20	0,63
TKFEN		0,938	6,75	0,00
TTKOM		151.497,000	1.118.047,86	2,32
KOZAA		64.627,000	325.720,08	0,67
SNGYO		0,793	1,11	0,00
KOZAL		16.682,000	722.330,60	1,50
EKGYO		301.156,000	936.595,16	1,94
IPEKE		26.671,000	132.821,58	0,28
TOPLAM		5.439.656,92	41.595.392,27	86,17

B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI

1. Devlet Tahvilleri

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TOPLAM		0,00	0,00	0,00

2. Hazine Bonoları

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TOPLAM		0,00	0,00	0,00

3. Tüfeye Endeksli Devlet Tahvilleri

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TOPLAM		0,00	0,00	0,00

4. Gelire Endeksli Senet Devlet Tahvilleri

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TOPLAM		0,00	0,00	0,00

C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ(TL)

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TOPLAM		0,00	0,00	0,00

D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ(DÖVİZE ENDEKSİ)

E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER

F) FİNANSMAN BONOLARI/ÖZEL SEKTÖR BONOLARI

1. Banka İştirak ve Hissedarları

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TOPLAM		0,00	0,00	0,00
KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TOPLAM		0,00	0,00	0,00

2. Diğer Ortaklıklar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
------------	-------------	----------------	--------------	------

TOPLAM			0,00	0,00	0,00
KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLER

1. Banka İştirak ve Hissedarları

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

2. Diğer Ortaklıklar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

3. Tüfe Endeksli Özel Sektör Tahviller

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

H) YABANCI MENKUL KIYMETLER

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

I) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

İ) DİĞER

1. O/N Repolar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TRT050314T14	01.02.2013	198.000,00	198.023,92	0,41	
TRT040117T14	01.02.2013	6.000.000,00	6.000.782,47	12,43	
O/N TOPLAM		6.198.000,00	6.198.806,39	12,84	

2. Vadeli Repolar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
VADELİ TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

3. Takasbank Repolar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TAKASBANK O/N TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

b) Takasbank Vadeli Repolar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
TAKASBANK VADELİ TOPLAM		0,00	0,00	0,00	
TAKASBANK TOPLAM		0,00	0,00	0,00	
REPOLAR TOPLAM		6.198.000,00	6.198.806,39	12,84	

4. Yatırım Fonu Katılma Belgeleri

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
YATIRIM FONLARI TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

5. Vadeli Mevduatlar

BANKA	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
VADELİ MEVDUAT TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

6. VOB

RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
0,00	0,00

7. Katılım Hesapları

BANKA	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN	
KATILIM HESAPLARI TOPLAM		0,00	0,00	0,00	

IV. FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A) FON PORTFOY DEĞERİ	48.268.576,66	100,00
B) HAZİR DEĞERLER	974,22	0,00
C) ALACAKLAR	0,00	0,00
1) Kıymet Satım Alacağı	0,00	
2) Cari Yıl Repo Stopaj Alacağı	0,00	
3) Geçmiş Yıl Repo Stopaj Alacağı	0,00	
4) Diğer Alacaklar	0,00	
D) BORÇLAR	201.460,92	0,42
1) Yönetim Ücreti	83.420,03	
2) Cari Yıl Vergi Karşılığı	0,00	
3) Geçmiş Yıl Vergi Karşılığı	0,00	
4) Kıymet Alım Borcu	0,00	
5) Denetim Ücretleri Karşılığı	2.826,02	
6) Diğer Borçlar	115.214,87	
7) SSDF Gideri	0,00	
FON TOPLAM DEĞERİ	48.068.089,96	100,00

VOB - VADELİ İŞLEMLER

Kısa Pozisyon (Satım Sözleşmesi)

Menkul Tanım	Vade	Pozisyon Sayısı	Uzlaşma Fiyatı
Uzun Pozisyon (Alım Sözleşmesi)	Vade	Pozisyon Sayısı	Uzlaşma Fiyatı

V - AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN
İhraç İzin Ücretleri	2.118,24	0,02
İlan Gideri	600,00	0,01
Sigorta Ücretleri	352,79	0,00
Aracılık Komisyonları	7.500,11	0,08
Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00	0,00
Fon Yönetim Ücreti	83.420,03	0,88
Denetim Ücretleri	281,94	0,00
Katılma Belgesi Basım Ücreti	0,00	0,00
Vergi Resim Harç vb Giderler	26,25	0,00
Diğer	0,00	0,00
Toplam	94.299,36	

TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.							
A TİPİ İMKB ULUSAL 30 ENDEKSİ FONU (HİSSE SENEDİ YOGUN FON)							
KORELASYON KATSAYISI							
TARİHİ	Endeks	Fiyat	xt-xort.	yt-yort.	xt-xort.* yt-yort	(xt-xort.)2	(yt-yort.)2

01.11.2012		90.502,60	0,035964	-0,0019734769	-5.527,49	10,91	0,0000038946	30.553.096,38
02.11.2012		88.906,27	0,035395	-0,0025424769	-7.123,82	18,11	0,0000064642	50.748.747,83
05.11.2012		90.790,41	0,036083	-0,0018544769	-5.239,68	9,72	0,0000034391	27.454.199,75
06.11.2012		89.730,00	0,035679	-0,0022584769	-6.300,09	14,23	0,0000051007	39.691.077,79
07.11.2012		89.253,72	0,035505	-0,0024324769	-6.776,37	16,48	0,0000059169	45.919.129,91
08.11.2012		90.659,66	0,036024	-0,0019134769	-5.370,43	10,28	0,0000036614	28.841.470,46
09.11.2012		89.501,78	0,035596	-0,0023414769	-6.528,31	15,29	0,0000054825	42.618.773,20
12.11.2012		88.833,31	0,035350	-0,0025874769	-7.196,78	18,62	0,0000066950	51.793.578,15
13.11.2012		89.760,88	0,035691	-0,0022464769	-6.269,21	14,08	0,0000050467	39.302.938,08
14.11.2012		88.815,58	0,035342	-0,0025954769	-7.214,51	18,73	0,0000067365	52.049.090,16
15.11.2012		89.124,83	0,035458	-0,0024794769	-6.905,26	17,12	0,0000061478	47.682.554,05
16.11.2012		88.061,10	0,035062	-0,0028754769	-7.968,99	22,91	0,0000082684	63.504.730,51
19.11.2012		87.887,97	0,034980	-0,0029574769	-8.142,12	24,08	0,0000087467	66.294.045,44
20.11.2012		87.777,22	0,034941	-0,0029964769	-8.252,87	24,73	0,0000089789	68.109.789,60
21.11.2012		87.398,31	0,034852	-0,0030854769	-8.631,78	26,63	0,0000095202	74.507.548,95
22.11.2012		86.932,76	0,034693	-0,0032444769	-9.097,33	29,52	0,0000105266	82.761.331,95
23.11.2012		88.349,21	0,035230	-0,0027074769	-7.680,88	20,80	0,0000073304	58.995.849,04
26.11.2012		89.510,44	0,035674	-0,0022634769	-6.519,65	14,76	0,0000051233	42.505.777,95
27.11.2012		89.580,13	0,035691	-0,0022464769	-6.449,96	14,49	0,0000050467	41.601.926,45
28.11.2012		89.647,05	0,035711	-0,0022264769	-6.383,04	14,21	0,0000049572	40.743.142,69
29.11.2012		90.255,98	0,035908	-0,0020294769	-5.774,11	11,72	0,0000041188	33.340.294,77
30.11.2012		91.059,21	0,036180	-0,0017574769	-4.970,88	8,74	0,0000030887	24.709.603,62
03.12.2012		92.795,26	0,036805	-0,0011324769	-3.234,83	3,66	0,0000012825	10.464.096,26
04.12.2012		94.608,40	0,037449	-0,0004884769	-1.421,69	0,69	0,0000002386	2.021.189,77
05.12.2012		95.340,07	0,037702	-0,0002354769	-690,02	0,16	0,0000000554	476.121,44
06.12.2012		94.896,42	0,037548	-0,0003894769	-1.133,67	0,44	0,0000001517	1.285.197,55
07.12.2012		95.432,27	0,037724	-0,0002134769	-597,82	0,13	0,0000000456	357.383,42
10.12.2012		95.930,32	0,037906	-0,0000314769	-99,77	0,00	0,0000000000	9.953,16
11.12.2012		95.994,83	0,037928	-0,0000094769	-35,26	0,00	0,0000000001	1.242,95
12.12.2012		96.815,17	0,038216	0,0002785231	785,08	0,22	0,0000000776	616.357,61
13.12.2012		96.220,67	0,038016	0,0000785231	190,58	0,01	0,0000000062	36.322,44
14.12.2012		95.215,76	0,037654	-0,0002834769	-814,33	0,23	0,0000000804	663.126,08
17.12.2012		96.873,29	0,038254	0,0003165231	843,20	0,27	0,0000001002	710.993,76
18.12.2012		96.659,63	0,038178	0,0002405231	629,54	0,15	0,0000000579	396.326,23
19.12.2012		95.850,50	0,037902	-0,0000354769	-179,59	0,01	0,0000000013	32.250,97
20.12.2012		95.817,55	0,037891	-0,0000464769	-212,54	0,01	0,0000000022	45.171,36
21.12.2012		95.695,08	0,037824	-0,0001134769	-335,01	0,04	0,0000000129	112.228,71
24.12.2012		96.555,16	0,038125	0,0001875231	525,07	0,10	0,0000000352	275.703,19
25.12.2012		96.900,56	0,038240	0,0003025231	870,47	0,26	0,0000000915	757.725,79
26.12.2012		97.442,30	0,038423	0,0004855231	1.412,21	0,69	0,0000002357	1.994.349,69
27.12.2012		98.154,65	0,038669	0,0007315231	2.124,56	1,55	0,0000000531	4.513.774,15
28.12.2012		98.230,35	0,038688	0,0007505231	2.200,26	1,65	0,0000000563	4.841.163,70
31.12.2012		97.728,24	0,038510	0,0005725231	1.698,15	0,97	0,0000003278	2.883.728,58
02.01.2013		99.555,77	0,039175	0,0012375231	3.525,68	4,36	0,0000015315	12.430.450,92
03.01.2013		100.014,38	0,039339	0,0014015231	3.984,29	5,58	0,0000019643	15.874.602,36
04.01.2013		99.362,09	0,039111	0,0011735231	3.332,00	3,91	0,0000013772	11.102.253,73
07.01.2013		100.153,04	0,039382	0,0014445231	4.122,95	5,96	0,0000020866	16.998.753,49
08.01.2013		100.074,08	0,039341	0,0014035231	4.043,99	5,68	0,0000019699	16.353.891,20
09.01.2013		101.408,72	0,039824	0,0018865231	5.378,63	10,15	0,0000035590	28.929.708,67
10.01.2013		100.865,60	0,039619	0,0016815231	4.835,51	8,13	0,0000028275	23.382.200,11
11.01.2013		101.091,28	0,039707	0,0017695231	5.061,19	8,96	0,0000031312	25.615.689,38
14.01.2013		102.333,55	0,040157	0,0022195231	6.303,46	13,99	0,0000049263	39.733.664,22
15.01.2013		102.815,30	0,040334	0,0023965231	6.785,21	16,26	0,0000057433	46.039.135,29
16.01.2013		105.058,47	0,041147	0,0032095231	9.028,38	28,98	0,0000103010	81.511.725,99
17.01.2013		106.234,13	0,041555	0,0036175231	10.204,04	36,91	0,0000130865	104.122.523,37
18.01.2013		106.476,98	0,041656	0,0037185231	10.446,89	38,85	0,0000138274	109.137.603,89
21.01.2013		106.680,86	0,041742	0,0038045231	10.650,77	40,52	0,0000144744	113.438.996,63
22.01.2013		107.217,37	0,041942	0,0040045231	11.187,28	44,80	0,0000160362	125.155.333,62
23.01.2013		108.070,69	0,042269	0,0043315231	12.040,60	52,15	0,0000187621	144.976.155,80
24.01.2013		108.094,29	0,042270	0,0043325231	12.064,20	52,27	0,0000187708	145.545.029,29
25.01.2013		105.795,14	0,041442	0,0035045231	9.765,05	34,22	0,0000122817	95.356.288,64
28.01.2013		101.114,97	0,039792	0,0018545231	5.084,88	9,43	0,0000034393	25.856.049,99
29.01.2013		102.442,01	0,040242	0,0023045231	6.411,92	14,78	0,0000053108	41.112.775,30
30.01.2013		98.014,48	0,038693	0,0007555231	1.984,39	1,50	0,0000005708	3.937.821,38
31.01.2013		97.587,46	0,038536	0,0005985231	1.557,37	0,93	0,0000003582	2.425.415,21
		96.030,09	0,037937			825,72	0,0002945291	2.315.259.172,02
							karekok	karekok
							0,0171618513	48.117,14
				Korelasyon Katsayısı		0,9999225399		