

[Mayıs Ayı İçin Tıklayınız.](#)

A TİPİ ULUSAL MALİ ENDEKS FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON) (811-TAU)
01.06.2013-30.06.2013 DÖNEMİ AYLIK RAPORU

I. FONU TANITICI BİLGİLER

a) Fonun Adı	A TİPİ ULUSAL MALİ ENDEKS FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON) (811-TAU)
b) Kurucunun Ünvanı	T. İŞ BANKASI A.Ş.
c) Yöneticinin Ünvanı	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
d) Fon Tutarı	15.000.000,00
e) Fon Toplam Değeri	34.823.219,05
f) Tedavüldeki Pay Sayısı	746.974.215,00
g) Fonun Kuruluş Tarihi	22.11.2000
h) Fonun Süresi	Süresizdir

II. FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

a) Ay Sonu Pay Fiyatı	0,046615
b) Önceki Ay Pay Fiyatı	0,053569
c) Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	-12,98
d) Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	-4,02
e) Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	18,86
f) Aylık Ort.Portföydeki M.K. Yüzdesi	100,00
g) Aylık Ort.Tedavül Oranı	48,54
h) Aylık Ort.Portföy Devir Hızı	5,52
i) Portföyün Ortalama vadesi	0,90

III. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

A) HİSSE SENETLERİ

1. Banka İştirak ve Hissedarları

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
SİSE		172.212,633	464.974,11	1,29
ANSGR		56.465,340	70.017,02	0,19
TSKB		221.470,204	423.008,09	1,17
ISGYO		127.064,598	177.890,44	0,49
ANHYT		44.653,697	190.224,75	0,53
ISFIN		88.529,495	84.103,02	0,23
İSMEN		29.448,796	43.878,71	0,12
TOPLAM		739.844,76	1.454.096,14	4,02

2. Diğer Ortaklıklar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
NTHOL		78.165,984	195.414,96	0,54
GLYHO		46.938,000	65.713,20	0,18
ALARK		19.708,756	113.916,61	0,32
AKBNK		629.569,658	4.948.417,51	13,69
KCHOL		206.664,770	1.913.715,77	5,29
AKGRT		33.943,000	87.572,94	0,24
GARAN		751.119,000	6.324.421,98	17,49
SAHOL		331.113,073	3.360.797,69	9,30
İSCTR		522.912,516	2.980.601,34	8,24
DOHOL		286.671,164	278.071,03	0,77
YKBNK		292.122,000	1.282.415,58	3,55
DYHOL		147.514,000	100.309,52	0,28
ECZYT		9.045,000	53.365,50	0,15
TEBNK		30.083,850	66.184,47	0,18
FINBN		0,291	0,88	0,00
IHLAS		182.291,000	149.478,62	0,41
YAZIC		9.801,000	231.303,60	0,64
VAKBN		236.316,000	1.136.679,96	3,14
SKBNK		53.100,999	99.298,87	0,27
TEKST		0,649	0,96	0,00
GSDHO		54.829,000	65.794,80	0,18
AGYO		0,079	0,09	0,00
ASYAB		174.335,000	312.059,65	0,86
ECILC		59.203,000	123.734,27	0,34
TAVHL		57.772,000	652.823,60	1,81
HALKB		231.171,000	3.779.645,85	10,45
ALBRK		63.837,762	117.461,48	0,32
TKFEN		53.852,047	355.423,51	0,98
SNGYO		79.694,500	91.648,68	0,25
AKFEN		38.117,000	176.481,71	0,49
TRGYO		24.463,428	85.377,36	0,24
EKGYO		214.824,000	584.321,28	1,62
SAFGY		114.641,000	95.152,03	0,26
GOZDE		10.515,000	51.102,90	0,14
HLGYO		66.741,696	81.424,87	0,23
TOPLAM		5.111.077,22	29.960.133,07	82,87

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 Tahvilleri

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
O/N TOPLAM		0,00	0,00	0,00

2. Vadeli Repolar

KIYMET ADI	VADE TARİHİ	NOMİNAL DEĞERİ	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN
TRT040117T14	01.07.2013	237.000,00	237.095,45	0,66
TRT140813T19	01.07.2013	4.500.000,00	4.502.034,25	12,45
VADELİ TOPLAM		4.737.000,00	4.739.129,70	13,11

3. Takasbank Repolar**a) Takasbank O/N 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		4.737.000,00	4.739.129,70	13,11

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	36.153.358,92	100,00
B) HAZIR DEĞERLER	1.443,14	0,00
C) ALACAKLAR	0,02	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	0,02	
D) BORÇLAR	1.331.583,03	3,68
1) Yönetim Ücreti	57.423,81	
2) Cari Yıl Vergi Karşılığı	0,00	
3) Geçmiş Yıl Vergi Karşılığı	0,00	
4) Kıymet Alım Borcu	1.235.310,14	
5) Denetim Ücretleri Karşılığı	2.192,94	
6) Diğer Borçlar	36.656,14	
7) SSDF Gideri	0,00	
FON TOPLAM DEĞERİ	34.823.219,05	100,00

VOB - VADELİ İŞLEMLER

Kısa Pozisyon (Satım Sözleşmesi)

Menkul Tanım	Vade	Pozisyon Sayısı	Uzlaşma Fiyatı
---------------------	-------------	------------------------	-----------------------

Uzun Pozisyon (Alım Sözleşmesi)

Menkul Tanım	Vade	Pozisyon Sayısı	Uzlaşma Fiyatı
---------------------	-------------	------------------------	-----------------------

V - AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN
İhraç İzin Ücretleri	1.741,15	0,03
İlan Gideri	655,20	0,01
Sigorta Ücretleri	349,51	0,01
Araçlık Komisyonları	3.312,78	0,05
Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00	0,00
Fon Yönetim Ücreti	57.423,81	0,90
Denetim Ücretleri	382,20	0,01
Katılma Belgesi Basım Ücreti	0,00	0,00
Vergi Resim Harç vb Giderler	26,25	0,00
Diğer	15,75	0,00
Toplam	63.906,65	

TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.								
A TİPİ İMKB ULUSAL MALİ ENDEKS FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)								
KORELASYON KATSAYISI								
TARİH	Endeks	Fiyat	xt-xort.	yt-yort.	xt-xort.* yt-yort	(xt-xort.)2	(yt-yort.)2	
01.04.2013	124.443,51	0,052820	0,0006876508	2.362,34	1,62	0,0000004729	5.580.639,03	
02.04.2013	124.076,69	0,052670	0,0005376508	1.995,52	1,07	0,0000002891	3.982.090,57	
03.04.2013	122.038,34	0,051876	-0,0002563492	-42,83	0,01	0,0000000657	1.834,61	
04.04.2013	119.422,77	0,050870	-0,0012623492	-2.658,40	3,36	0,0000015935	7.067.103,22	
05.04.2013	117.921,15	0,050301	-0,0018313492	-4.160,02	7,62	0,0000033538	17.305.786,21	
08.04.2013	120.528,46	0,051307	-0,0008253492	-1.552,71	1,28	0,0000006812	2.410.915,74	
09.04.2013	119.415,43	0,050878	-0,0012543492	-2.665,74	3,34	0,0000015734	7.106.182,44	
10.04.2013	118.726,59	0,050727	-0,0014053492	-3.354,58	4,71	0,0000019750	11.253.222,95	
11.04.2013	121.955,86	0,051971	-0,0001613492	-125,31	0,02	0,0000000260	15.703,19	
12.04.2013	123.010,75	0,052362	0,0002296508	929,58	0,21	0,0000000527	864.114,55	
15.04.2013	124.354,40	0,052875	0,0007426508	2.273,23	1,69	0,0000005515	5.167.563,81	
16.04.2013	123.216,91	0,052443	0,0003106508	1.135,74	0,35	0,0000000965	1.289.899,94	
17.04.2013	122.167,04	0,052086	-0,0000463492	85,87	0,00	0,0000000021	7.373,25	
18.04.2013	119.930,85	0,051241	-0,0008913492	-2.150,32	1,92	0,0000007945	4.623.886,34	
19.04.2013	120.669,25	0,051514	-0,0006183492	-1.411,92	0,87	0,0000003824	1.993.524,81	
22.04.2013	122.009,97	0,052011	-0,0001213492	-71,20	0,01	0,0000000147	5.069,78	
24.04.2013	123.713,69	0,052662	0,0005296508	1.632,52	0,86	0,0000002805	2.665.113,78	
25.04.2013	123.986,52	0,052768	0,0006356508	1.905,35	1,21	0,0000004041	3.630.349,55	
26.04.2013	123.876,94	0,052731	0,0005986508	1.795,77	1,08	0,0000003584	3.224.781,34	
29.04.2013	124.339,71	0,052918	0,0007856508	2.258,54	1,77	0,0000006172	5.100.992,18	
30.04.2013	125.835,39	0,053489	0,0013566508	3.754,22	5,09	0,0000018405	14.094.149,93	
02.05.2013	130.790,98	0,055407	0,0032746508	8.709,81	28,52	0,0000107233	75.860.748,76	
03.05.2013	131.771,77	0,055760	0,0036276508	9.690,60	35,15	0,0000131599	93.907.682,21	
06.05.2013	132.841,55	0,056284	0,0041516508	10.760,38	44,67	0,0000172362	115.785.726,50	
07.05.2013	132.012,93	0,055965	0,0038326508	9.931,76	38,06	0,0000146892	98.639.809,40	
08.05.2013	135.062,90	0,057112	0,0049796508	12.981,73	64,64	0,0000247969	168.525.251,98	
09.05.2013	133.467,49	0,056521	0,0043886508	11.386,32	49,97	0,0000192603	129.648.228,92	
10.05.2013	132.986,59	0,056323	0,0041906508	10.905,42	45,70	0,0000175616	118.928.133,45	
13.05.2013	133.470,40	0,056514	0,0043816508	11.389,23	49,90	0,0000191989	129.714.505,76	
14.05.2013	136.086,29	0,057578	0,0054456508	14.005,12	76,27	0,0000296551	196.143.319,52	
15.05.2013	137.656,26	0,058185	0,0060526508	15.575,09	94,27	0,0000366346	242.583.354,34	
16.05.2013	137.514,95	0,058132	0,0059996508	15.433,78	92,60	0,0000359958	238.201.491,59	
17.05.2013	137.337,18	0,058064	0,0059316508	15.256,01	90,49	0,0000351845	232.745.768,47	
20.05.2013	133.578,19	0,056613	0,0044806508	11.497,02	51,51	0,0000200762	132.181.414,13	
21.05.2013	135.129,59	0,057192	0,0050596508	13.048,42	66,02	0,0000256001	170.261.202,36	
22.05.2013	139.069,57	0,058702	0,0065696508	16.988,40	111,61	0,0000431603	288.605.653,66	
23.05.2013	135.542,22	0,057357	0,0052246508	13.461,05	70,33	0,0000272970	181.199.803,00	

24.05.2013	135.230,47	0,057228	0,0050956508	13.149,30	67,00	0,0000259657	172.904.027,87
27.05.2013	133.450,92	0,056562	0,0044296508	11.369,75	50,36	0,0000196218	129.271.160,92
28.05.2013	131.462,42	0,055798	0,0036656508	9.381,25	34,39	0,0000134370	88.007.806,89
29.05.2013	126.948,89	0,054078	0,0019456508	4.867,72	9,47	0,0000037856	23.694.674,82
30.05.2013	127.711,78	0,054375	0,0022426508	5.630,61	12,63	0,0000050295	31.703.742,16
31.05.2013	125.451,17	0,053569	0,0014366508	3.370,00	4,84	0,0000020640	11.356.883,95
03.06.2013	112.052,78	0,048401	-0,0037313492	-10.028,39	37,42	0,0000139230	100.568.653,75
04.06.2013	117.293,70	0,050398	-0,0017343492	-4.787,47	8,30	0,0000030080	22.919.891,80
05.06.2013	115.011,98	0,049516	-0,0026163492	-7.069,19	18,50	0,0000068453	49.973.480,92
06.06.2013	109.869,25	0,047571	-0,0045613492	-12.211,92	55,70	0,0000208059	149.131.048,24
07.06.2013	113.817,89	0,049065	-0,0030673492	-8.263,28	25,35	0,0000094086	68.281.835,71
10.06.2013	110.497,51	0,047774	-0,0043583492	-11.583,66	50,49	0,0000189952	134.181.234,16
11.06.2013	108.374,04	0,046957	-0,0051753492	-13.707,13	70,94	0,0000267842	187.885.478,11
12.06.2013	110.833,27	0,047901	-0,0042313492	-11.247,90	47,59	0,0000179043	126.515.307,97
13.06.2013	110.145,64	0,047628	-0,0045043492	-11.935,53	53,76	0,0000202892	142.456.933,22
14.06.2013	115.651,43	0,049750	-0,0023823492	-6.429,74	15,32	0,0000056756	41.341.587,09
17.06.2013	114.025,26	0,049135	-0,0029973492	-8.055,91	24,15	0,0000089841	64.897.724,29
18.06.2013	112.020,07	0,048353	-0,0037793492	-10.061,10	38,02	0,0000142835	101.225.781,12
19.06.2013	113.545,96	0,048932	-0,0032003492	-8.535,21	27,32	0,0000102422	72.849.850,39
20.06.2013	105.252,67	0,045783	-0,0063493492	-16.828,50	106,85	0,0000403142	283.198.492,39
21.06.2013	103.977,38	0,045278	-0,0068543492	-18.103,79	124,09	0,0000469821	327.747.298,57
24.06.2013	99.559,73	0,043607	-0,0085253492	-22.521,44	192,00	0,0000726816	507.215.366,92
25.06.2013	100.073,30	0,043813	-0,0083193492	-22.007,87	183,09	0,0000692116	484.346.446,74
26.06.2013	104.451,85	0,045499	-0,0066333492	-17.629,32	116,94	0,0000440013	310.793.007,61
27.06.2013	107.102,97	0,046519	-0,0056133492	-14.978,20	84,08	0,0000315097	224.346.546,56
28.06.2013	107.342,45	0,046619	-0,0055133492	-14.738,72	81,26	0,0000303970	217.229.937,42
	122.081,17	0,052132			2.587,70	0,0009878057	6.784.366.590,86
						karekök	karekök
						0,0314293765	82.367,27
			Korelasyon Katsayısı		0,9995955447		