

DENİZBANK A.Ş A TİPİ İMKB ULUSAL 100 ENDEKSİ FONU - HİSSE SENEDİ YOĞUN FON - DZE

31/12/2014 Tarihli Aylık Raporudur.

Aralık 14

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	A TİPİ İMKB ULUSAL 100 ENDEKSİ FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	DENİZBANK A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.
D. FON TUTARI	30,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	7,372,667.34
F. KATILMA PAYI SAYISI:	142,681,000.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	04.07.2001
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.051672
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.051936
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.51%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.00%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	27.19%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ	
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	

Hisse Senedi 96.73%

Varant

Devlet Tahvili

Özel Sektör Tahvili

Finansman Bonosu

Banka Bonosu

Hazine Bonosu

Devlet Tahvili Repo 3.27%

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

Yabancı Sabit Getiriler

Euro Bond (Euro Tahvil Turk)

Opsiyon

Yabancı Hisse Senetleri

Vadeli Mevduat TL

Vadeli Mevduat Döviz

G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI: 4.63%

H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI: 0.00%

Hisse Senedi

Devlet Borçlanma Senetleri 0.00%

I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ: 2.000

J. AYLIK KORELASYON : 0.999300

K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :	0.9995%
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:	937,014.51
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	870,559.89

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AEFES	4,726.00	107,280.20	1.45%
AKBNK	58,580.00	507,302.80	6.86%
ARCLK	7,973.00	119,595.00	1.62%
ASELS	8,368.95	100,427.40	1.36%
AYGAZ	7,189.00	70,667.87	0.95%
BIMAS	6,004.00	300,200.00	4.06%
CCOLA	2,857.00	144,278.50	1.95%
EKGYO	28,554.00	79,094.58	1.07%
ENKAI	26,485.57	139,843.81	1.89%
EREGL	73,844.48	329,346.38	4.45%
FROTO	3,641.00	118,514.55	1.60%
GARAN	72,876.00	686,491.92	9.28%
HALKB	23,527.00	327,025.30	4.42%
ISCTR	68,045.00	458,623.30	6.20%
ISGYO	0.74	1.05	0.00%
KCHOL	24,415.00	302,746.00	4.09%
KRDMD	38,667.65	79,268.68	1.07%
MGROS	9,553.00	217,330.75	2.94%
PETKM	33,082.00	130,673.90	1.77%
PGSUS	2,857.00	94,709.55	1.28%
SAHOL	46,789.00	474,908.35	6.42%
SISE	31,649.43	115,203.93	1.56%
TAVHL	8,368.00	159,828.80	2.16%
TCELL	35,937.00	513,899.10	6.94%
THYAO	28,554.00	274,975.02	3.72%
TKFEN	8,368.00	48,450.72	0.65%
TOASO	7,582.00	120,932.90	1.63%
TRKCM	0.36	1.24	0.00%
TSKB	38,593.91	77,959.70	1.05%
TTKOM	14,178.00	103,074.06	1.39%
TTRAK	691.00	53,103.35	0.72%
TUPRS	6,794.00	375,708.20	5.08%
ULKER	4,726.00	87,667.30	1.18%
VAKBN	25,500.00	124,440.00	1.68%
YKBNK	30,225.00	147,800.25	2.00%
TOPLAM :	789,202.09	6,991,374.46	94.47%

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:

H) GELİRE ENDEKSİ 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:				
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
RRP TRT060121T16	236,117.03	236,058.51	3.19%	
RRP TRT270116T18	173,085.32	173,042.65	2.34%	
TOPLAM :	409,202.35	409,101.16	5.53%	
FON PORTFÖY DEĞERİ	1,198,404.44	7,400,475.62		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	7,400,475.62	100.38%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	1,631.79	0.02%		
C. ALACAKLAR (+) :	0.00	0.00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	29,440.07	0.40%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	7,372,667.34			
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	4,158.44			
37002Denetim Ücreti	662.78			
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	39.41			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	27.20			
37006Saklama Giderleri	302.13			
37009Noter Tasdik ve Ücreti	792.18			
37012Portföy Yönetim Ücreti	4,158.56			
370141İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	777.17			
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	368.65			
37099Diğer Giderler	88.03			
TOPLAM	11,374.55			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELŞİZ HİSSE SENEDİ ALIM. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal			
7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal	Satış Değeri
8- İTFALAR				

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal		
9- PORTFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değeri
Devlet Tahvili Repo	TRT150715T17	01/12/14-02/12/14	125,558.00	120,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	02/12/14-03/12/14	133,780.00	133,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	03/12/14-04/12/14	70,740.00	69,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	03/12/14-04/12/14	51,260.00	50,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	04/12/14-05/12/14	31,180.00	31,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	04/12/14-05/12/14	71,415.00	71,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	05/12/14-08/12/14	60,370.00	60,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	08/12/14-09/12/14	12,065.00	12,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	08/12/14-09/12/14	53,275.00	53,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	09/12/14-10/12/14	171,860.00	171,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	10/12/14-11/12/14	69,335.00	69,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	10/12/14-11/12/14	128,620.00	128,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	11/12/14-12/12/14	184,860.00	184,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	12/12/14-15/12/14	161,820.00	161,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	15/12/14-16/12/14	6,025.00	6,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	15/12/14-16/12/14	167,660.00	167,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT040117T14	16/12/14-17/12/14	166,035.00	163,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	17/12/14-18/12/14	101,365.00	101,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	17/12/14-18/12/14	2,010.00	2,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240724T15	18/12/14-19/12/14	159,985.00	162,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT080323T10	19/12/14-22/12/14	546,740.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270116T18	19/12/14-22/12/14	14,245.00	12,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	22/12/14-23/12/14	451,160.00	450,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	22/12/14-23/12/14	47,715.00	47,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	23/12/14-24/12/14	394,465.00	389,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	24/12/14-25/12/14	365,745.00	365,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	25/12/14-26/12/14	353,225.00	349,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240118T19	26/12/14-29/12/14	350,315.00	355,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	29/12/14-30/12/14	302,950.00	301,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	30/12/14-31/12/14	127,000.00	126,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	30/12/14-31/12/14	187,475.00	186,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	31/12/14-02/01/15	164,840.00	236,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270116T18	31/12/14-02/01/15	170,925.00	173,000.00
TOPLAM :			5,406,018.00	5,402,000.00
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:				
Verilen Ödünçler	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
TOPLAM :			0.00	0.00
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00