

APP-AK PORTFÖY P1 SERBEST ÖZEL FON

Aralık 2015

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	APP-AK PORTFÖY P1 SERBEST ÖZEL FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	AKPORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	AKPORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	200.000.000,00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200.000.000,00
F-)Fon Toplam Değeri	:	28.987.793,04
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	29.137.810,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	1 Aralık 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	0,994851
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	0,000000
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0,94
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0,94
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	87,91
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) BPP	:	0,00
g-) Opsiyon	:	0,00
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	2,51
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	9,58
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	14,100
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,04
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1.378,38

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
---------	------	---------------	--------------	-------

APP-AK PORTFÖY P1 SERBEST ÖZEL FON
Aralık 2015

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLER				
Eurobond				
XS0806482948	19/07/17	835.000,00	2.507.626,16	8,65
USM0300LAC02	09/03/18	1.210.000,00	3.795.390,20	13,09
XS0849020556	02/05/18	860.000,00	2.516.580,24	8,68
XS1028938915	22/10/19	1.715.000,00	5.034.373,57	17,37
XS0882347072	05/02/20	900.000,00	2.489.967,16	8,59
XS1219733752	22/04/20	860.000,00	2.508.389,01	8,65
XS1121459074	30/04/20	865.000,00	2.514.075,02	8,67
XS0849728190	01/11/22	1.345.000,00	3.774.208,97	13,02
	TOPLAM:	8.590.000,00	25.140.610,33	86,72
D ER				
AZF-PY PY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI ÖZEL FONU		302.926.299,00	3.848.981,56	13,28
	TOPLAM:	302.926.299,00	3.848.981,56	13,28
PORTFÖY DEĞERİ:		311.516.299,00	28.989.591,89	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	28.989.591,89	100,01 %
B-)HAZIR DEĞERLER	8.630,55	0,03 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-10.429,40	-0,04 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	28.987.793,04	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
-----------------	--------------	--------------

APP-AK PORTFÖY P1 SERBEST ÖZEL FON

Aralık 2015

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,30	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	4.757,71	0,0164 %
Kayda Alma Ücreti	499,34	0,0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1.231,51	0,0042 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	29,90	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	4.918,78	0,0170 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	13,86	0,0000 %
Diğer Harcamalar	1,31	0,0000 %
BPP BSMV	0,02	0,0000 %
TOPLAM:	11.452,73	0,0394 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
0,000	0,00	29.137.810,000	29.141.459,39

Serbest Fon Risk Raporu											31.12.2015
Fon Adı	Fon Toplam Değeri	Açık Pozisyon Tutarı	Toplam RMD (TL)	Toplam RMD (%)	Kaldıraç Yaratın İşlem RMD (TL)	Kaldıraç Yaratın İşlem RMD (%)	Benchmark RMD (TL)	Benchmark RMD (%)	Mutlak RMD Limiti	Görel RMD Limiti	Kaldıraç Limiti
APP	32,574,913	-	433,812	1.33%	-		330,228	1.01%	8.00%		1.0

Gerçekleşen Kaldıraç TL	Gerçekleşen Kaldıraç	Gerçekleşen Kaldıraç Bilgileri
-	0.00	

Aylık Rapor (Stres Test)										
Fon Adı	Original PV	Analysis PV	Toplam RMD (TL)	Toplam RMD (%)	Benchmark RMD (%)	Mutlak RMD Limiti	Uyarı 1 (Mutlak RMD Limiti *)	Uyarı 2 (Mutlak RMD Limiti *)	Sensitivity Analysis Scenario	FED EXIT Stres RMD/FTD
APP	32,574,913	32,335,354	239,560	0.74	-2.51	10.00	7.50	8.50	Serbest	1.39

Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örnekleme Sayısı
11.12.2014	30.11.2015	Tarihsel Benzetim	0.99	EWMA	252

Aylık Rapor (Backtest)					
Fon Adı	Fon Toplam Değeri	Geriy Dönük Test Aşım Sayısı	Geriy Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Geriy Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Gözlem Sayısı
APP	32,574,913	0	3	5	252

RMD Parametreleri	
Parametre	Uygulama
RMD Hesaplama Yöntemi	Tarihsel Simülasyon
Güven Düzeyi	99.00%
Elde Tutma Süresi	1 gün
Tarihi Gözlem Aralığı	1 yıl
Volatilite Tahmin Yöntemi	EWMA (Üstsel Hareketli Ağırlıklı Ortalama)

* Borsa dışı türev araç ve swap sözleşmesi bulunmamaktadır.