

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON**Mart 2016****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	AKPORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	AKPORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	200.000.000.000,00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200.000.000.000,00
F-)Fon Toplam Değeri	:	120.641.386,25
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	110.332.487,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	7 Eylül 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1,093435
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1,015011
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	7,73
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	9,82
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	7,37
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	98,21
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) BPP	:	0,08
g-) Opsiyon	:	0,00
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	1,71
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	0,054
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	0,00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON**Mart 2016****III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU**

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
H SSE SENETLER				
ADANA		403.704,00	2.834.002,08	2,41
ADANA		39.000,00	273.780,00	0,23
AKCNS		728.427,00	10.467.495,99	8,91
AKGRT		310.000,00	589.000,00	0,50
ANHYT		87.067,00	486.704,53	0,41
CIMSA		53.872,00	847.945,28	0,72
CIMSA		8.694,00	136.843,56	0,12
GARAN		408.500,00	3.366.040,00	2,87
ISCTR		14.989.650,00	69.851.769,00	59,48
KCHOL		995.113,00	14.240.067,03	12,13
KORDS		164.410,00	868.084,80	0,74
SAHOL		73.705,00	717.886,70	0,61
TCELL		167.500,00	1.984.875,00	1,69
TTKOM		90.000,00	601.200,00	0,51
UNYEC		390.314,00	1.588.577,98	1,35
	TOPLAM:	18.909.956,00	108.854.271,95	92,68
MEVDUAT				
Mevduat	01/04/16	3.000.286,86	8.475.556,68	7,22
	TOPLAM:	3.000.286,86	8.475.556,68	7,22
BPP				
BPP	01/04/16	115.040,96	115.040,96	0,10
	TOPLAM:	115.040,96	115.040,96	0,10
PORTFÖY DEĞERİ:		22.025.283,82	117.444.869,59	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

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

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON**Mart 2016****IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	117.444.869,59	97,35 %
B-)HAZIR DEĞERLER	347,27	0,00 %
C-)ALACAKLAR	3.627.487,77	3,01 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-431.318,38	-0,36 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	120.641.386,25	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	210,72	0,0002 %
Fon Yönetim Ücreti	10.731,62	0,0089 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	2.631,64	0,0022 %
Kayda Alma Ücreti	6.032,07	0,0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2.273,34	0,0019 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	31,50	0,0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	470,89	0,0004 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	30,24	0,0000 %
BPP BSMV	9,18	0,0000 %
TOPLAM:	22.421,20	0,0186 %

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

Sirketin Unvanı	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
ANHYT	Temmettü	28/03/16	0,00	21.235,85

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON
Mart 2016

Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
0,000	0,00	8.095.782,000	8.680.886,82

Serbest Fon Risk Rapor											31.03.2016
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
ARP	116,145,704	-	3,981,564	3.43%	-		110,636	0.10%	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
ARP	116,145,704	105,725,672	10,420,032	8.97	0.08	10.00	0.75	0.85	Serbest	5.98

Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örnekleme Sayısı
13.04.2015	31.03.2016	Tarihsel Benzetim	0.99	EWMA	252

Aylık Rapor (Backtest)						31.03.2016
Fon Adı	Fon Toplam Değeri	Geriy Dönük Test Aşım Sayısı	Geriy Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Geriy Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Gözlem Sayısı	
ARP	116,145,704	1	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.