

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON

Nisan 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	:	125.906.567,02
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	:	1,141156
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1,093435
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	4,36
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	14,61
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	6,36
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	94,91
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) BPP	:	2,67
g-) Opsiyon	:	0,00
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	2,42
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	0,055
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	:	0,71

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

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

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
H SSE SENETLER				
ADANA		482.238,00	3.693.943,08	2,93
ADANA		10.000,00	76.600,00	0,06
AKCNS		728.427,00	10.533.054,42	8,35
AKGRT		310.000,00	620.000,00	0,49
ANHYT		87.067,00	498.893,91	0,39
CIMSA		62.566,00	1.019.200,14	0,81
CIMSA		15.000,00	244.350,00	0,19
GARAN		408.500,00	3.521.270,00	2,79
ISCTR		14.989.650,00	73.599.181,50	58,30
KCHOL		995.113,00	14.558.503,19	11,53
KORDS		164.410,00	968.374,90	0,77
SAHOL		73.705,00	744.420,50	0,59
TCELL		167.500,00	2.026.750,00	1,61
TTKOM		90.000,00	608.400,00	0,48
UNYEC		390.314,00	1.660.395,76	1,32
	TOPLAM:	18.974.490,00	114.373.337,40	90,61
MEVDUAT				
Mevduat	03/05/16	3.000.762,37	8.406.473,51	6,66
	TOPLAM:	3.000.762,37	8.406.473,51	6,66
BPP				
BPP	02/05/16	2.506.294,76	2.506.294,76	1,99
BPP	02/05/16	936.857,79	936.857,79	0,74
	TOPLAM:	3.443.152,55	3.443.152,55	2,73
PORTFÖY DEĞERİ:		25.418.404,92	126.222.963,46	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

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

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

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	126.222.963,46	100,25 %
B-)HAZIR DEĞERLER	18.424,22	0,01 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-334.820,66	-0,27 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	125.906.567,02	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1.770,21	0,0014 %
Fon Yönetim Ücreti	11.543,74	0,0092 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	233,12	0,0002 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2.463,86	0,0020 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	150,00	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	470,89	0,0004 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	186,81	0,0001 %
BPP BSMV	271,54	0,0002 %
TOPLAM:	17.090,17	0,0136 %

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
AKCNS	Temmettü	01/04/16	0,00	980.098,53
CIMSA	Temmettü	01/04/16	0,00	80.269,28
ISCTR	Temmettü	01/04/16	0,00	2.567.119,96
SAHOL	Temmettü	05/04/16	0,00	11.055,75
KORDS	Temmettü	06/04/16	0,00	51.230,16

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON**Nisan 2016**

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Deęeri	TUTAR
KCHOL	Temmettü	14/04/16	0,00	289.577,88
GARAN	Temmettü	27/04/16	0,00	55.147,50

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
0,000	0,00	0,000	0,00

Serbest Fon Risk Raporu											29.04.2016		
Fon Adı	Fon Toplam Değeri	Açık Pozisyon Tutarı	Toplam RMD (TL)	Toplam RMD (%)	Kaldıraç Yaratan İşlem RMD (TL)	Kaldıraç Yaratan İşlem RMD (%)	Benchmark RMD (TL)	Benchmark RMD (%)	Mutlak RMD Limiti	Görelî RMD Limiti	Kaldıraç Limiti	Gerçekleşen Kaldıraç TL	Gerçekleşen Kaldıraç
ARP	124,552,672	-	4,177,828	3.35%	-		80,206	0.06%	8.00%		1.0	-	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	124,552,672	113,616,448	10,936,220	8.78	0.08	10.00	0.75	0.85	Serbest	5.88

Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı
12.05.2015	29.04.2016	Tarihsel Benzetim	0.99	EWMA	252

Aylık Rapor (Backtest)						29.04.2016
Fon Adı	Fon Toplam Değeri	Geriyeye Dönük Test Aşım Sayısı	Geriyeye Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Geriyeye Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Gözlem Sayısı	
ARP	124,552,672	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.