

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/05/2016 ve 31/05/2016

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	ASHMORE PORTFÖY DEĞİŞKEN FON
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	ASHMORE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİNİN ÜNVANI:	ASHMORE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI: (TL)	50,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER: (TL)	2,478,866.45
E. KATILMA PAYI SAYISI :	154,002,328
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	20/05/2009
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	0.016096
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.015896
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1.26%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	5.31%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	10.56%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
PAY	24.17%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	58.16%
TÜREV TEMİNAT	2.48%
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI	15.18%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	3.08%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	0.14%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.00%
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.00%
Kira Sertifikaları Devir Hızı :	0.00%
Yabancı Menkul Kıymetler Devir Hızı :	0.00%
Altın Devir Hızı :	0.00%
Varant Devir Hızı :	0.00%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	336.111
H. KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	
I. KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	42.25
J. AYLIK KORELASYON:	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:	

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
AKBNKE	2,700.00	21,519.00	0.87%
ALBRKE	8,000.00	11,360.00	0.46%
ALBRKE	9,250.00	13,135.00	0.53%
ALBRKE	6,000.00	8,520.00	0.34%
ARCLKE	300	5,883.00	0.24%
ARCLKE	115	2,255.15	0.09%
ASELSE	700	6,979.00	0.28%
ASELSE	1,300.00	12,961.00	0.52%
AYGAZE	250	2,755.00	0.11%
AYGAZE	300	3,306.00	0.13%
AYGAZE	750	8,265.00	0.33%
AYGAZE	200	2,204.00	0.09%
AYGAZE	500	5,510.00	0.22%
BAGFSE	1,250.00	15,962.50	0.64%
BIMASE	8	463.2	0.02%
BIMASE	60	3,474.00	0.14%
BIMASE	45	2,605.50	0.10%
BIMASE	60	3,474.00	0.14%
BIMASE	202	11,695.80	0.47%
BIMASE	125	7,237.50	0.29%
BRISAE	275	2,015.75	0.08%
BRISAE	450	3,298.50	0.13%
BRISAE	275	2,015.75	0.08%
CIMSAE	200	3,160.00	0.13%
CIMSAE	200	3,160.00	0.13%
CIMSAE	100	1,580.00	0.06%
CIMSAE	300	4,740.00	0.19%
CIMSAE	550	8,690.00	0.35%
CIMSAE	150	2,370.00	0.10%
CIMSAE	400	6,320.00	0.25%
CIMSAE	200	3,160.00	0.13%
DOCO E	35	10,510.50	0.42%
DOCO E	60	18,018.00	0.73%
DOCO E	10	3,003.00	0.12%
DOCO E	5	1,501.50	0.06%
DOCO E	30	9,009.00	0.36%
EGEENE	1	255.8	0.01%
EGEENE	5	1,279.00	0.05%

EGEENE	15	3,837.00	0.15%
EGEENE	15	3,837.00	0.15%
EGEENE	15	3,837.00	0.15%
FROTOE	130	4,547.40	0.18%
FROTOE	430	15,041.40	0.61%
GARANE	1,750.00	13,230.00	0.53%
ISGYOE	2,848.21	4,841.97	0.19%
ISGYOE	3,987.93	6,779.49	0.27%
ISGYOE	8,545.57	14,527.48	0.58%
ISMENE	0.54	0.54	
KARTNE	45	11,754.00	0.47%
KARTNE	20	5,224.00	0.21%
KARTNE	5	1,306.00	0.05%
KARTNE	10	2,612.00	0.11%
KCHOLE	100	1,311.00	0.05%
KCHOLE	200	2,622.00	0.11%
KCHOLE	600	7,866.00	0.32%
KCHOLE	500	6,555.00	0.26%
KCHOLE	750	9,832.50	0.40%
LOGO E	100	5,660.00	0.23%
NETASE	175	1,806.00	0.07%
OTKARE	85	8,274.75	0.33%
PETKME	325	1,381.25	0.06%
PETKME	1,050.00	4,462.50	0.18%
PETKME	825	3,506.25	0.14%
PETKME	7,500.00	31,875.00	1.28%
SASA E	2,000.00	6,260.00	0.25%
SASA E	1,250.00	3,912.50	0.16%
SASA E	1,750.00	5,477.50	0.22%
SASA E	1,000.00	3,130.00	0.13%
SASA E	1,400.00	4,382.00	0.18%
SODA E	2,684.61	12,295.52	0.49%
SODA E	280	1,282.40	0.05%
SODA E	200	916	0.04%
SODA E	1,500.00	6,870.00	0.28%
SODA E	500	2,290.00	0.09%
TATGDE	1,000.00	5,340.00	0.21%
TATGDE	460	2,456.40	0.10%
TAVHLE	450	6,813.00	0.27%
TBORGE	1,000.00	6,496.00	0.26%
TBORGE	500	3,248.00	0.13%

TBORGE	500	3,248.00	0.13%
TBORGE	800	5,196.80	0.21%
TBORGE	800	5,196.80	0.21%
TKFENE	250	1,790.00	0.07%
TKFENE	2,000.00	14,320.00	0.58%
TKFENE	300	2,148.00	0.09%
TKNSAE	1,300.00	7,969.00	0.32%
TSKB E	5,500.00	8,525.00	0.34%
TSKB E	8,400.00	13,020.00	0.52%
TTKOME	450	2,713.50	0.11%
TTRAKE	90	7,330.50	0.30%
TTRAKE	40	3,258.00	0.13%
TUPRSE	95	6,327.00	0.25%
TUPRSE	65	4,329.00	0.17%
ULKERE	100	2,134.00	0.09%
ULKERE	150	3,201.00	0.13%
ULKERE	350	7,469.00	0.30%
ULKERE	225	4,801.50	0.19%
ULKERE	125	2,667.50	0.11%
ULKERE	180	3,841.20	0.15%
YATASE	2,800.00	9,604.00	0.39%
Ana Grup Toplamı	105,882.88	600,438.10	24.17%
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSANLZ91617	100,000.00	103,669.66	4.17%
TRSAZEV71716	100,000.00	100,894.15	4.06%
TRSBMKS91614	100,000.00	102,420.92	4.12%
TRSBMKS91713	10,000.00	10,328.17	0.42%
TRSCLKE11711	50,000.00	50,701.05	2.04%
TRSCLKE11711	70,000.00	70,981.46	2.86%
TRSCLKE11711	10,000.00	10,140.21	0.41%
TRSDSTF31710	10,000.00	10,332.62	0.42%
TRSDSTF71617	100,000.00	101,690.38	4.09%
TRSEKOFK1615	70,000.00	70,138.10	2.82%
TRSKOTN81713	90,000.00	90,448.30	3.64%
TRSLBTVK1711	20,000.00	20,388.91	0.82%
TRSLBTVK1711	10,000.00	10,194.46	0.41%
TRSLBTV31716	30,000.00	30,895.82	1.24%
TRSLBTV71712	40,000.00	41,492.06	1.67%
TRSLBTV71712	20,000.00	20,746.03	0.84%

TRSLDFK91619	50,000.00	51,220.65	2.06%
TRSLDFK91619	30,000.00	30,732.39	1.24%
TRSPLDG81716	130,000.00	134,828.17	5.43%
TRSRNSH11919	20,000.00	20,282.81	0.82%
TRSRNSH11919	20,000.00	20,282.81	0.82%
TRSRNSH11919	60,000.00	60,848.42	2.45%
TRSRSGY21818	50,000.00	50,054.54	2.02%
TRSTIMG51718	70,000.00	70,398.71	2.83%
TRSTIMG51718	20,000.00	20,113.92	0.81%
TRSTIMG51718	40,000.00	40,227.83	1.62%
TRSULFK21719	90,000.00	90,313.08	3.64%
TRSULFK21719	10,000.00	10,034.79	0.40%
Toplam	1,420,000.00	1,444,800.42	58.17%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELIR ORT.SEN)			
GES(GELIRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	1,420,000.00	1,444,800.42	58.16%
B.2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRT270923T11	119	114.69	
Toplam	119	114.69	
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELIR ORT.SEN)			
GES(GELIRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	119	114.69	
Ana Grup Toplamı	1,420,119.00	1,444,915.11	58.16%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	57,783.75	61,546.25	2.48%
Toplam	57,783.75	61,546.25	2.48%
ALIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	57,783.75	61,546.25	2.47%
D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI			

YABANCI TAHVİL			
İKRAZ İŞT. SER			
YABANCI KIRA SER			
YP HİSSE			
BORSA YATIRIM FONLARI			
YP VARANT			
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI			
TBPP	377,115.17	377,115.17	15.18%
Toplam	377,115.17	377,115.17	15.18%
MEVDUAT			
YP MEVDUAT			
YATIRIM FONU			
Ana Grup Toplamı	377,115.17	377,115.17	15.18%
FON PORTFOY DEĞERİ	1,960,900.80	2,484,014.62	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	2,484,014.62	100.21%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	1,525.55	0.06%	
C. ALACAKLAR (+) :	108.11		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0		
E. BORÇLAR (-) :	6,781.83	0.27%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	2,478,866.45		

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	3,960.43
370.02.000-Denetim Ücreti	148.2
370.04.000-Aracılık Komisyonu	34.43
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	130.1
370.06.000-Saklama Giderleri	90.93
370.15.001-BPP Kom	162.7
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	41.51
370.23.000-Futures İşlemi Kom	1.95

370.27.000-BPP İşlem Masrafı	32.58
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,890.00
TOPLAM	6,492.83

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

Açıklama	Nominal (TL)	
ISGYO Bds:% 14		13,500.00
TKFEN Tem:% 16		2,550.00
ASELS Bds:% 100		1,000.00
TTKOM Tem:% 24		450

VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal	Satış Değ.
Pay	ASELS	11.05.2016	300	5,961.00
Pay	EGEEN	12.05.2016	19	5,270.60
TBPP		02.05.16-03.05.16	2.62	131,000.00
TBPP		02.05.16-03.05.16	5.38	269,000.00
TBPP		03.05.16-04.05.16	8	400,000.00
TBPP		04.05.16-05.05.16	7.92	396,000.00
TBPP		05.05.16-06.05.16	7.92	396,000.00
TBPP		06.05.16-09.05.16	3	150,000.00
TBPP		06.05.16-09.05.16	4.92	246,000.00
TBPP		09.05.16-10.05.16	6.64	332,000.00
TBPP		10.05.16-11.05.16	6.54	327,000.00
TBPP		11.05.16-12.05.16	6.94	347,000.00
TBPP		12.05.16-13.05.16	7.02	351,000.00
TBPP		13.05.16-16.05.16	7.14	357,000.00
TBPP		16.05.16-17.05.16	7.24	362,000.00
TBPP		17.05.16-18.05.16	7.26	363,000.00
TBPP		18.05.16-20.05.16	7.26	363,000.00
TBPP		20.05.16-23.05.16	7.26	363,000.00
TBPP		23.05.16-24.05.16	7.26	363,000.00
TBPP		24.05.16-25.05.16	7.26	363,000.00
TBPP		25.05.16-26.05.16	7.46	373,000.00
TBPP		26.05.16-27.05.16	7.46	373,000.00
TBPP		27.05.16-30.05.16	7.46	373,000.00

TBPP	30.05.16-31.05.16	7.46	373,000.00
TBPP	31.05.16-01.06.16	7.54	377,000.00

VIII- İTFALAR

Sermaye Piyasası Aracı	İtfa Tarihi	Nominal (TL)
------------------------	-------------	--------------

IX- PORTFÖYE ALIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değ.
Pay	AKBNK	05.05.2016	2,700.00	20,655.00
Pay	BAGFS	05.05.2016	1,250.00	17,325.00
Pay	CIMSA	05.05.2016	200	3,036.00
Pay	SODA	05.05.2016	500	2,185.00
Pay	GARAN	05.05.2016	1,750.00	13,440.00
Pay	TBORG	05.05.2016	800	4,904.00
Pay	ULKER	05.05.2016	180	3,722.40
Pay	AYGAZ	06.05.2016	500	5,475.00

X- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ

Sermaye Piyasası Aracı	Menkul Kıymet	İşlem-Vade Tarihi	Nominal	Cari Piyasa Değeri
------------------------	---------------	-------------------	---------	--------------------

XI- TÜREV ARAÇ İŞLEMLERİ

VADELİ İŞLEM SÖZLEŞMELERİ

Sermaye Piyasası Aracı	ISIN	İşlem Tarihi	Fiyat	Nominal	Cari Piyasa Değeri	Kısa/Uzun
Vadeli İşlem Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300616S0-FNY	VIOP-05.05.2016	97.35	1	9,735.00	Kısa