

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON

Mayıs 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	:	117.049.402,96
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	:	1,060879
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1,141156
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-7,03
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6,55
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-5,27
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	94,74
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	:	2,59
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	:	19,02

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
H SSE SENETLER				
ADANA		509.897,00	3.115.470,67	2,66

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

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN%
AKCNS		728.427,00	9.892.038,66	8,45
AKGRT		310.000,00	629.300,00	0,54
ANHYT		87.067,00	444.912,37	0,38
CIMSA		102.566,00	1.620.542,80	1,39
GARAN		408.500,00	3.088.260,00	2,64
ISCTR		14.989.650,00	67.603.321,50	57,77
KCHOL		995.113,00	13.045.931,43	11,15
KORDS		164.410,00	965.086,70	0,82
SAHOL		73.705,00	677.348,95	0,58
TCELL		167.500,00	1.802.300,00	1,54
TTKOM		90.000,00	542.700,00	0,46
UNYEC		390.314,00	1.483.193,20	1,27
	TOPLAM:	19.017.149,00	104.910.406,28	89,65

MEVDUAT

Mevduat	27/06/16	1.000.000,00	2.953.111,40	2,52
Mevduat	27/06/16	1.000.000,00	2.953.111,40	2,52
Mevduat	27/06/16	1.001.344,53	2.957.081,97	2,53
	TOPLAM:	3.001.344,53	8.863.304,77	7,57

BPP

BPP	01/06/16	3.250.997,26	3.250.997,26	2,78
	TOPLAM:	3.250.997,26	3.250.997,26	2,78

PORTFÖY DEĞERİ: 25.269.490,79 117.024.708,31 100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	117.024.708,31	99,98 %
B-)HAZIR DEĞERLER	16.976,40	0,01 %
C-)ALACAKLAR	21.622,14	0,02 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-13.903,89	-0,01 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	117.049.402,96	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1.640,89	0,0014 %

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON**Mayıs 2016****V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	10.420,31	0,0089 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	225,60	0,0002 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	3.419,13	0,0029 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	80,80	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	455,70	0,0004 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	139,09	0,0001 %
Lisans Giderleri	885,00	0,0008 %
BPP BSMV	294,77	0,0003 %
TOPLAM:	17.561,29	0,0151 %

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

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
ADANA	Temmettü	25/05/16	0,00	463.623,85
UNYEC	Temmettü	27/05/16	0,00	173.533,60

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											31.05.2016
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
ARP	116,945,216	-	3,858,364	3.30%	-		57,351	0.05%	8.00%		1.0

Gerçekleşen Kaldıraç TL	Gerçekleşen Kaldıraç
-	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	116,945,216	106,815,784	10,129,436	8.66	0.08	10.00	0.75	0.85	Serbest	5.80

Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı
10.06.2015	31.05.2016	Tarihsel Benzetim	0.99	EWMA	252

Aylık Rapor (Backtest)						31.05.2016
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	116,945,216	2	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.