

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON

Haziran 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	:	117.347.597,36
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	:	1,063582
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1,060879
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0,25
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6,82
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1,68
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	94,56
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,46
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) BPP	:	2,63
g-) Opsiyon	:	0,00
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	2,35
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	:	0,25
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	2.635,91

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
H SSE SENETLER				
ADANA		509.897,00	2.931.907,75	2,50

ARP-AK PORTFÖY PY SERBEST 1. FON

Haziran 2016

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN%
AKCNS		728.427,00	9.943.028,55	8,47
AKGRT		310.000,00	592.100,00	0,51
ANHYT		91.314,16	461.136,51	0,39
CIMSA		134.618,00	2.039.462,70	1,74
GARAN		408.500,00	3.096.430,00	2,64
ISCTR		14.989.650,00	68.352.804,00	58,24
KCHOL		995.113,00	13.055.882,56	11,13
KORDS		164.410,00	994.680,50	0,85
SAHOL		73.705,00	694.301,10	0,59
TCELL		167.500,00	1.770.475,00	1,51
TTKOM		90.000,00	544.500,00	0,46
UNYEC		390.314,00	1.378.979,36	1,17
	TOPLAM:	19.053.448,16	105.855.688,03	90,20

BORÇLANMA SENETLER

Eurobond				
XS1376681067	09/03/26	2.700.000,00	8.565.449,21	7,30
	TOPLAM:	2.700.000,00	8.565.449,21	7,30
MEVDUAT				
Mevduat	09/08/16	45.868,00	132.336,26	0,11
	TOPLAM:	45.868,00	132.336,26	0,11
BPP				
BPP	01/07/16	2.800.978,08	2.800.978,08	2,39
	TOPLAM:	2.800.978,08	2.800.978,08	2,39
PORTFÖY DEĞERİ:		24.600.294,24	117.354.451,58	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	117.354.451,58	100,01 %
B-)HAZIR DEĞERLER	13.574,71	0,01 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-20.428,93	-0,02 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	117.347.597,36	100,00 %

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

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1.673,97	0,0014 %
Fon Yönetim Ücreti	10.402,57	0,0089 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	225,60	0,0002 %
Kayda Alma Ücreti	5.867,38	0,0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2.513,07	0,0021 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	31,50	0,0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	455,70	0,0004 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	90,72	0,0001 %
BPP BSMV	258,59	0,0002 %
TOPLAM:	21.519,10	0,0183 %

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
TTKOM	Temmettü	01/06/16	0,00	21.622,14

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 Rapor											30.06.2016
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	118,508,824	-	3,885,824	3.28%	-		54,519	0.05%	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	118,508,824	107,731,072	10,777,749	9.09	0.08	10.00	0.75	0.85	Serbest	5.71

Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örnekleme Sayısı
10.07.2015	30.06.2016	Tarihsel Benzetim	0.99	EWMA	252

Aylık Rapor (Backtest)						30.06.2016
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	118,508,824	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.