

Aralık 2016 Portföy Dağılım Raporu

1- FONU TANITICI BİLGİLER				
A. FONUN ADI:	Troya Portföy Değişken Fon			
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TROYA PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	TROYA PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
D. FON TUTARI	0,00			
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	460.075,93			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	454.356,00			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/09/2016			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZDİR			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	1,012589			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1,005544			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0,70%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	1,26%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1,26%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	19,27%			
Varant				
Devlet Tahvili				
Özel Sektör Tahvili	8,65%			
Finansman Bonosu	0,1969			
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	0,1676			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları				
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi				
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	0,3005			
Kıymetli Madenler				
VOB İşlemleri				

VOB Nakit Teminat İşlemleri				
Yabancı Sabit Getiriliiler				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)				
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri				
Vadeli Mevduat TL	0,0558			
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0,0092			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	5,899			
Devlet Borçlanma Senetleri	0			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	43,61			
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. AYLIK TAKİP HATASI :				
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
N. AYLIK TAKİP FARKI :				
O. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI :				
P. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
R. GEÇEN AYKİ TAKİP FARKI :				
S. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN				
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	1.522,24			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	0,00			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ				
AKSA	510	4681,8	0,0094	
AKSA	250,00	2.295,00	0,46%	
KORDS	3.070,00	19.832,20	3,96%	
SODA	3.650,00	19.308,50	3,86%	
TKFEN	1.400,00	9.044,00	1,81%	
TTRAK	61	4575	0,0091	
TUPRS	265	18748,75	0,0375	
TUPRS	10	707,5	0,0014	
TUPRS	25	1768,75	0,0035	
TUPRS	35	2476,25	0,005	
TUPRS	55	3891,25	0,0078	
ULKER	2611	42193,76	0,0843	
TOPLAM :	11942	129522,76	0,2589	
B) VARANTLAR:				

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:				
D) BANKA BONOLARI:				
E) FİNANSMAN BONOLARI:				
TRFDNFK31717	40000	39115,25	0,0782	
TRFLDFK61718	40000	40144,69	0,0803	
TRFZORFK1717	10000	10107,06	0,0202	
TOPLAM :	90000	89367	0,1787	
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:				
TRQPASH11716	40000	39724,65	0,0794	
TOPLAM :	40000	39724,65	0,0794	
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
O) VOB İŞLEMLERİ:				
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
VL Vadeli Mevduat TL	13155,22	13138,79	0,0263	
VL Vadeli Mevduat TL	12.363,25	12359,2	0,0247	
BPP	216170,43	216113,61	0,432	
TOPLAM :	241688,9	241611,6	0,483	
FON PORTFÖY DEĞERİ	383630,9	500226,01		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	500226,01	108,73%		
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	3756,65	0,82%		
C. ALACAKLAR (+) :	5.596,03	1,22%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0,00	0,00%		
E. BORÇLAR (-) :	49502,76	10,76%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	460.075,93			
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	-2381,32			
37002Denetim Ücreti	-3458,65			
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	-1,26			
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	-152,14			
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	-125,64			
37004Aracılık Komisyonu	-397,93			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	-143,8			
37006Saklama Giderleri	-45,24			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	-174,90			
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	-3,79			
37045Fon Saklama Ücreti	-2575,04			
37098Küsürat farkları	-0,13			
TOPLAM	-9.459,84			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI				
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM.				
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA				
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal Değeri		
TRT141216T10	14/12/2016	800000		
8- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal Değeri	Tutar
Verilen Ödünçler				

TOPLAM :			0	0
Alinan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0