

AVZ-AK PORTFÖY SERBEST DÖVİZ FON

Şubat 2017

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	AVZ-AK PORTFÖY SERBEST DÖVİZ FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	AKPORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	AKPORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	200.000.000,00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200.000.000,00
F-)Fon Toplam Değeri	:	80.349.092,50
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	22.099.054,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	13 Şubat 2017
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	3,635861
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	0,000000
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	91,34
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) BPP	:	0,00
g-) Opsiyon	:	0,00
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	0,00
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	8,66
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	11,050
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,08
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1.842,05

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLER

AVZ-AK PORTFÖY SERBEST DÖVİZ FON

Şubat 2017

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYIÇ DEĞERİ	ORAN%
Eurobond				
US900123BY51	25/03/22	3.000.000,00	11.227.686,46	14,00
US900123BZ27	26/09/22	3.200.000,00	12.611.541,13	15,73
XS1412393172	18/05/21	1.100.000,00	3.917.794,08	4,89
XS1439838548	13/07/21	2.300.000,00	8.101.793,29	10,10
XS1028943089	23/09/21	1.100.000,00	4.022.548,72	5,02
XS1508914691	27/10/21	3.400.000,00	12.351.024,06	15,40
XS1508390090	21/04/22	4.400.000,00	16.017.284,13	19,97
USM8931TAF68	13/09/22	1.100.000,00	4.045.431,55	5,05
USM0375YAK49	24/10/22	2.200.000,00	7.893.973,91	9,84
	TOPLAM:	21.800.000,00	80.189.077,33	100,00
PORTFÖY DEĞERİ:		21.800.000,00	80.189.077,33	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	80.189.077,33	99,80 %
B-)HAZIR DEĞERLER	197.449,95	0,25 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-37.434,78	-0,05 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	80.349.092,50	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	35.307,83	0,0439 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	128,48	0,0002 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1.655,43	0,0021 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	86,90	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	343,04	0,0004 %
Varlıkların Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	302,94	0,0004 %
TOPLAM:	37.824,62	0,0471 %

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

AVZ-AK PORTFÖY SERBEST DÖVİZ FON**Şubat 2017**

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	0,000	0,00	22.099.054,000	81.211.813,54

Serbest Fon Risk Rapor												28.02.2017	
Fon Adı	Fon Toplam Değeri	Açık Pozisyon Tutarı	Toplam RMD (TL)	Toplam RMD (%)	Kaldıraç Yaratıcı İşlem RMD (TL)	Kaldıraç Yaratıcı İşlem RMD (%)	Benchmark RMD (TL)	Benchmark RMD (%)	Mutlak RMD Limiti	Görelî RMD Limiti	Kaldıraç Limiti	Gerçekleşen Kaldıraç TL	Gerçekleşen Kaldıraç
AVZ	80,399,721	-	1,594,348	1.98%	-	-	1,575,078	1.96%	10.00%		5,0	-	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
AVZ	80,399,721	80,158,145	-241,577	-0.30	3.91	10.00	7.50	8.50	Serbest	-2.14

Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örnekleme Sayısı
29/02/2016	28/02/2017	Tarihsel Benzetim	0.99	EWMA	252

Aylık Rapor (Backtest)						28/02/2017
Fon Adı	Fon Toplam Değeri	Geriye Dönük Test Aşım Sayısı	Geriye Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Geriye Dönük Test Aşım Sayısı Limiti	Gözlem Sayısı	Gözlem Sayısı
AVZ	80,399,721	0	3	5	252	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)

* Fon önceden belirlenmiş olan kaldıraç ve risk limitlerine uyumlu yönetilmiştir.

** Borsa dışı türev araç ve swap sözleşmesi bulunmamaktadır.