

Mayıs 2014 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER				
A. FONUN ADI:	EID Ergo Sigorta A.Ş. Dinamik A Tipi YF			
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	Ergo Sigorta A.Ş.			
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	Ergo Portföy Yönetimi A.Ş.			
D. FON TUTARI		5,000,000.00		
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:		3,456,670.66		
F. KATILMA PAYI SAYISI:		110,147,080.00		
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	17/04/2003			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI		0.031382		
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:		0.030102		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:		4.25%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:		10.98%		
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:		-4.00%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi		47.16%		
Varant				
Devlet Tahvili		47.73%		
Özel Sektör Tahvili				
Finansman Bonosu				
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo		3.67%		

Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları				
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi				
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası				
Kıymetli Madenler				
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri		1.44%		
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)				
Opsiyon				
Yabancı Hisse Senetleri				
Vadeli Mevduat TL				
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:		22.03%		
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:		26.61%		
Hisse Senedi				
Devlet Borçlanma Senetleri		135.25%		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:		1,696.62		
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. AYLIK TAKİP HATASI :				
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
N. AYLIK TAKİP FARKI :				
O. GEÇEN AYKI TAKİP HATASI :				
P. GEÇEN AYKI TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
R. GEÇEN AYKI TAKİP FARKI :				
S. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN				
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:		0		

T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:		0		
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ				
AKBNK	11,000.35	89,982.86	2.60%	
AKENR	55,000.19	64,350.22	1.86%	
AKFGY	80,000.00	103,200.00	2.99%	
AKSEN	10,000.00	29,700.00	0.86%	
ALBRK	40,000.00	67,600.00	1.96%	
ANACM	14,000.00	25,480.00	0.74%	
BANVT	15,000.00	36,900.00	1.07%	
BIZIM	2,250.00	42,525.00	1.23%	
GARAN	10,000.00	85,500.00	2.48%	
HALKB	11,000.00	179,300.00	5.19%	
INDES	30,000.00	135,000.00	3.91%	
ISCTR	15,000.00	89,550.00	2.59%	
MGROS	5,000.00	102,000.00	2.95%	
RYSAS	0.06	0.05	0.00%	
SAHOL	5,000.00	51,000.00	1.48%	
SNGYO	30,000.00	26,700.00	0.77%	
TCELL	6,500.00	85,475.00	2.47%	
THYAO	12,000.00	85,560.00	2.48%	
TRKCM	15,000.00	36,450.00	1.06%	
TTKOM	20,000.00	121,400.00	3.51%	
VAKBN	20,000.00	101,200.00	2.93%	
TOPLAM :	406,750.60	1,558,873.13	45.13%	
B) VARANTLAR:				
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:				
TRT070115T13	100,000.00	101,420.39	2.94%	

TRT080524T17	400,000.00	413,403.96	11.97%
TRT130515T11	400,000.00	388,152.64	11.24%
TRT240914T15	88,000.00	88,968.95	2.58%
TRT261022T10	400,000.00	456,357.00	13.21%
TRT270116T18	100,000.00	104,011.98	3.01%
TOPLAM :	1,488,000.00	1,552,314.91	44.94%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
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:				
TL		48,051.63	48,051.63	1.39%
TOPLAM :		48,051.63	48,051.63	1.39%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
RRP TRT270923T11		295,218.22	295,218.22	8.55%
TOPLAM :		295,218.22	295,218.22	8.55%
FON PORTFÖY DEĞERİ		2,238,020.45	3,454,457.89	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı		%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:		3,454,457.89	99.94%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :		9,591.27	0.28%	
C. ALACAKLAR (+) :		4,002.43	0.12%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :		0	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :		11,380.93	0.33%	
FON TOPLAM DEĞERİ:		3,456,670.66		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti		10,462.62		
37002Denetim Ücreti		199.95		
370031SGMK Tahvil Borsa Payı		67.86		
370032ON RRP Tahvil Borsa Payı		29.45		
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı		34.15		
37004Aracılık Komisyonu		261.24		
37005Vergi, Resim ve Harçlar		69.8		
37006Saklama Giderleri		49.51		

TOPLAM		11,174.58		
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal			
BİZİM Tem:%32		2,250.00		
İNDES Tem:%5		30,000.00		
TTKOM Tem:%26		20,000.00		
ANACM Tem:%7		14,000.00		
TRKCM Tem:%4		15,000.00		
VAKBN Tem:%4		20,000.00		
7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal	Satış Değeri
Devlet Tahvili	TRT070115T13	09/05/2014	200,000.00	200,781.43
Devlet Tahvili	TRT110614T13	12/05/2014	200,000.00	198,526.00
Devlet Tahvili	TRT240216T10	14/05/2014	100,000.00	105,138.46
Devlet Tahvili	TRT270923T11	14/05/2014	100,000.00	97,696.15
Devlet Tahvili	TRT270923T11	22/05/2014	500,000.00	498,818.68
TOPLAM :			1,100,000.00	1,100,960.72
Hisse Senedi	EKGYO	06/05/2014	33,000.00	93,720.00
Hisse Senedi	KRDMD	07/05/2014	25,000.00	38,750.00
Hisse Senedi	AKBNK	22/05/2014	5,000.00	39,000.00
Hisse Senedi	AKBNK	28/05/2014	4,000.00	32,640.00
Hisse Senedi	GARAN	28/05/2014	6,500.00	55,575.00
8- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal		
9- PORTFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değeri

Devlet Tahvili	TRT261022T10	09/05/2014	400,000.00	446,602.06
Devlet Tahvili	TRT270923T11	12/05/2014	200,000.00	195,743.96
Devlet Tahvili	TRT080524T17	23/05/2014	100,000.00	102,787.24
Devlet Tahvili	TRT080524T17	23/05/2014	300,000.00	308,361.72
TOPLAM :			1,000,000.00	1,053,494.98
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	02/05/14-05/05/14	2,160.00	3,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240118T19	02/05/14-05/05/14	124,200.00	122,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	05/05/14-06/05/14	13,625.00	19,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT110614T13	05/05/14-06/05/14	115,000.00	106,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	06/05/14-07/05/14	93,180.00	130,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240914T15	07/05/14-08/05/14	135,845.00	130,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	08/05/14-09/05/14	170,795.00	220,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060814T18	09/05/14-12/05/14	15,230.00	15,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270116T18	12/05/14-13/05/14	15,380.00	15,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060814T18	13/05/14-14/05/14	15,215.00	15,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	14/05/14-15/05/14	49,940.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	15/05/14-16/05/14	74,855.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT040117T14	16/05/14-20/05/14	15,000.00	11,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240914T15	16/05/14-20/05/14	61,580.00	59,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060814T18	20/05/14-21/05/14	70,875.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	21/05/14-22/05/14	74,270.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	22/05/14-23/05/14	72,720.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	23/05/14-26/05/14	167,345.00	160,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	26/05/14-27/05/14	137,910.00	195,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT191114T18	27/05/14-28/05/14	218,355.00	200,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	28/05/14-29/05/14	31,085.00	44,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	28/05/14-29/05/14	163,555.00	156,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060814T18	29/05/14-30/05/14	201,655.00	200,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	30/05/14-02/06/14	311,460.00	295,000.00
TOPLAM :			2,351,235.00	2,445,000.00
Hisse Senedi	ISCTR	12/05/2014	8,000.00	42,720.00
Hisse Senedi	TCELL	12/05/2014	3,000.00	37,050.00
Hisse Senedi	THYAO	12/05/2014	7,000.00	47,320.00

Hisse Senedi	TTKOM	12/05/2014	5,000.00	30,900.00
TOPLAM :			23,000.00	157,990.00
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0