

Ekim 2014 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	ALTERNATİFBANK A.Ş A TİPİ DEĞİŞKEN YATIRIM FONU
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	ALTERNATİFBANK A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	ALTERNATİF YATIRIM A.Ş
D. FON TUTARI	1000000
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	3592327.1
F. KATILMA PAYI SAYISI:	939066
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/08/1993
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	3.825426
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	3.550619
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.0774
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.2631
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.1137
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	0.8039
Varant	
Devlet Tahvili	0.0294
Özel Sektör Tahvili	0.105
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	

Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	0.0136
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.0482
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.0094
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	0.2775
Hisse Senedi	
Devlet Borçlanma Senetleri	0
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	261.104
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:	14998.41

T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:

0

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
ANACM	32096.38	60983.12	0.0171
ASELS	10000	101000	0.0283
AYEN	40440	84115.2	0.0236
DYOBY	100654	200301.46	0.0562
ECILC	60981	143305.35	0.0402
EREGL	0.77	3.57	0
HALKB	22000	326700	0.0917
ISCTR	55000	305800	0.0858
ISFIN	0.3	0.28	0
KLGYO	0.26	0.3	0
MGROS	10000	206500	0.0579
MNDRS	30000.48	33300.53	0.0093
MUTLU	23	188.37	0.0001
RYSAS	170000.03	127500.02	0.0358
SISE	0.71	2.4	0
SODA	0.77	3.17	0
TATGD	15915	50450.55	0.0142
TCELL	22000	283800	0.0796
TEKST	100000	183000	0.0513
THYAO	25000	182250	0.0511
TKFEN	35000	195650	0.0549
TRKCM	70000.5	204401.46	0.0573
TSKB	20000.3	39000.58	0.0109
VAKBN	30000	143400	0.0402
YKBNK	20000	97400	0.0273
TOPLAM :	869113.5	2969056.36	0.833

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

TRT130515T11	100000	100698.7	0.0283
TOPLAM :	100000	100698.7	0.0283

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

TRSPRMF81518	190000	196182.14	0.055
TRSZORNE1512	150000	150831.71	0.0423
TOPLAM :	340000	347013.86	0.0974

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	101364.99	101364.99	0.0284
TOPLAM :	101364.99	101364.99	0.0284

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:

BPP	46032.58	46032.58	0.0129
TOPLAM :	46032.58	46032.58	0.0129

FON PORTFÖY DEĞERİ	1456511.07	3564166.49	
--------------------	------------	------------	--

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	3564166.49	0.9922
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	733.13	0.0002
C. ALACAKLAR (+) :	38830.7	0.0108
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0
E. BORÇLAR (-) :	11403.22	0.0032
FON TOPLAM DEĞERİ:	3592327.1	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	11335.12
37004Aracılık Komisyonu	559.33
37005Vergi, Resim ve Harçlar	27.2
37006Saklama Giderleri	30.51
37008Banka Masrafları	0.22
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	19.92
37023VOB İşlemi Komisyonu	1226.76

37097FİG Giderleri 0.57

TOPLAM 13199.63

6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI.
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama Nominal

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR:

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal	Satış Değeri
Borsa Para Piyasası		14/10/2014	300000	300000
Borsa Para Piyasası		15/10/2014	83000	83000
Borsa Para Piyasası		16/10/2014	57000	57000
Borsa Para Piyasası		17/10/2014	97000	97000
Borsa Para Piyasası		20/10/2014	72000	72000
Borsa Para Piyasası		21/10/2014	42000	42000
Borsa Para Piyasası		22/10/2014	42000	42000
Borsa Para Piyasası		23/10/2014	42000	42000
Borsa Para Piyasası		24/10/2014	42000	42000
Borsa Para Piyasası		27/10/2014	42000	42000
Borsa Para Piyasası		28/10/2014	42000	42000
Borsa Para Piyasası		30/10/2014	42000	42000
Borsa Para Piyasası		31/10/2014	46000	46000
TOPLAM :			949000	949000
Hisse Senedi	TSKB	01/10/2014	30000	58200
Hisse Senedi	ASELS	13/10/2014	5000	50250
Hisse Senedi	ECILC	13/10/2014	20000	42800
Hisse Senedi	TSKB	13/10/2014	10656	20779.2
Hisse Senedi	AYEN	15/10/2014	1394	2551.02
Hisse Senedi	AYEN	15/10/2014	43096	79727.6
Hisse Senedi	AYEN	16/10/2014	10000	19200

TOPLAM :			120146	273507.82
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	13/10/2014	9	82507.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	13/10/2014	4	36670
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	13/10/2014	1	9167.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	13/10/2014	1	9167.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	13/10/2014	5	45837.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	14/10/2014	20	184800
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	3	27825
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	5	46375
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	3	27825
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	1	9275
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	1	9275
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	7	64925
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	17/10/2014	15	139237.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	20/10/2014	29	270642.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	20/10/2014	1	9332.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	20/10/2014	18	167400
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	20/10/2014	2	18600

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRFULFKE1413	02/10/2014	150000

9- PORTFÖYE ALIŞLAR:

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değeri
Hisse Senedi	HALKB	13/10/2014	5000	69000
Hisse Senedi	HALKB	13/10/2014	4000	56400
Hisse Senedi	ISCTR	13/10/2014	10000	49700
Hisse Senedi	ISCTR	13/10/2014	5000	24900
Hisse Senedi	VAKBN	13/10/2014	10000	42900
Hisse Senedi	YKBNK	13/10/2014	20000	87600
Hisse Senedi	TKFEN	14/10/2014	5000	25250
Hisse Senedi	HALKB	15/10/2014	3000	42150

Hisse Senedi	VAKBN	16/10/2014	10000	44900
Hisse Senedi	VAKBN	17/10/2014	10000	44700
TOPLAM :			82000	487500
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	13/10/2014	20	181600
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	14/10/2014	20	183300
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	14/10/2014	20	184200
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	20	184300
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	20	185150
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/10/2014	5	46237.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	17/10/2014	20	185250
TOPLAM :			125	1150037.5

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0