

Eylül 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:	3319775.79
F. KATILMA PAYI SAYISI:	934985
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/08/1993
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	3.550619
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	3.618059
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.0186
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.1723
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.0733
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	0.7361
Varant	
Devlet Tahvili	0.0292
Özel Sektör Tahvili	0.147
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	0.0438
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.0439
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:	0.373
Hisse Senedi	
Devlet Borçlanma Senetleri	0
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	237.862
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:	10000.32

T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:

42174.9

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
ANACM	32096.38	52317.1	0.0159
ASELS	15000	138000	0.042
AYEN	94930	158533.1	0.0483
DYOBY	100654	205334.16	0.0625
ECILC	80981	173299.34	0.0528
EREGL	0.77	3.26	0
HALKB	10000	137000	0.0417
ISCTR	40000	202400	0.0616
ISFIN	0.3	0.28	0
KLGYO	0.26	0.3	0
MGROS	10000	184500	0.0562
MNDRS	30000.48	24900.4	0.0076
MUTLU	23	188.6	0.0001
RYSAS	170000.03	122400.02	0.0373
SISE	0.71	2.05	0
SODA	0.77	2.91	0
TATGD	15915	45198.6	0.0138
TCELL	22000	261800	0.0797
TEKST	100000	202000	0.0615
THYAO	25000	161750	0.0492
TKFEN	30000	151800	0.0462
TRKCM	70000.5	178501.27	0.0543
TSKB	60656.3	116460.1	0.0355
TOPLAM :	907259.5	2516391.49	0.7661

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT130515T11	100000	99246.47	0.0302
TOPLAM :	100000	99246.47	0.0302
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRFULFKE1413	150000	154402.57	0.047
TRSPRMF81518	190000	193892.34	0.059
TRSZORNE1512	150000	153334.89	0.0467
TOPLAM :	490000	501629.8	0.1527
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:			
F_XU0301014S0	20	92.03	0
TOPLAM :	20	92.03	0

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	167269.66	167269.66	0.0509
TOPLAM :	167269.66	167269.66	0.0509
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
FON PORTFÖY DEĞERİ	1664529.16	3284537.42	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	3284537.42	0.9894
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	25.61	0
C. ALACAKLAR (+) :	45434.79	0.0137
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0
E. BORÇLAR (-) :	10222.03	0.0031
FON TOPLAM DEĞERİ:	3319775.79	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	10147.71
37004Aracılık Komisyonu	685.32
37005Vergi, Resim ve Harçlar	27.2
37006Saklama Giderleri	71.9
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	119.34
37023VOB İşlemi Komisyonu	2146.79
37097FİG Giderleri	0.27
TOPLAM	13198.53

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		01/09/2014	421000	421000
Borsa Para Piyasası		02/09/2014	447000	447000
Borsa Para Piyasası		03/09/2014	300000	300000
Borsa Para Piyasası		04/09/2014	300000	300000
Borsa Para Piyasası		05/09/2014	300000	300000
Borsa Para Piyasası		08/09/2014	371000	371000
Borsa Para Piyasası		09/09/2014	239000	239000
Borsa Para Piyasası		10/09/2014	239000	239000
Borsa Para Piyasası		11/09/2014	191000	191000
Borsa Para Piyasası		12/09/2014	11000	11000
Borsa Para Piyasası		15/09/2014	111000	111000
Borsa Para Piyasası		16/09/2014	111000	111000
Borsa Para Piyasası		17/09/2014	46000	46000
Borsa Para Piyasası		18/09/2014	31000	31000
Borsa Para Piyasası		19/09/2014	31000	31000
Borsa Para Piyasası		22/09/2014	13000	13000
Borsa Para Piyasası		23/09/2014	13000	13000
Borsa Para Piyasası		24/09/2014	57000	57000
Borsa Para Piyasası		25/09/2014	57000	57000
Borsa Para Piyasası		26/09/2014	57000	57000
TOPLAM :			3346000	3346000
Hisse Senedi	TRKCM	02/09/2014	25000	66750
Hisse Senedi	THYAO	04/09/2014	10000	70900
Hisse Senedi	DYOBY	15/09/2014	10000	21400

Hisse Senedi	TKFEN	16/09/2014	10000	53500
Hisse Senedi	AYEN	22/09/2014	27030	44058.9
Hisse Senedi	AYEN	29/09/2014	5070	8466.9
TOPLAM :			87100	265075.8
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	02/09/2014	20	200650
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/09/2014	1	9572.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/09/2014	19	181877.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/09/2014	20	191600
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	5	48000
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	1	9600
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	1	9600
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	5	48000
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	6	57600
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	2	19200
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	8	77180
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	1	9647.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	1	9647.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	20	183400
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	6	55020
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	1	9170
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	13	119210

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
--------------------	-------------	---------

9- PORTFÖYE ALIŞLAR:

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değeri
Hisse Senedi	ASELS	01/09/2014	5000	48750
Hisse Senedi	ASELS	01/09/2014	5000	48850
Hisse Senedi	ASELS	01/09/2014	5000	48900
Hisse Senedi	TRKCM	05/09/2014	20000	53800
Hisse Senedi	TRKCM	05/09/2014	25000	67500
Hisse Senedi	TSKB	09/09/2014	25656	47976.72

Hisse Senedi	HALKB	10/09/2014	5000	78250
Hisse Senedi	ISCTR	10/09/2014	10000	54600
Hisse Senedi	TSKB	10/09/2014	25000	46500
Hisse Senedi	THYAO	15/09/2014	5000	34100
Hisse Senedi	TKFEN	15/09/2014	10000	51900
Hisse Senedi	THYAO	16/09/2014	10000	67800
Hisse Senedi	TSKB	18/09/2014	10000	18400
TOPLAM :			160656	667326.72
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	9	89797.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	4	39910
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	7	69842.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	6	59865
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	7	69842.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	7	69842.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	20	199400
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	11	109532.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	1	9957.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	09/09/2014	8	79660
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	10/09/2014	5	49350
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	10/09/2014	3	29610
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	10/09/2014	3	29610
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	10/09/2014	1	9870
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	10/09/2014	8	78960
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	10/09/2014	20	196750
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	11/09/2014	4	38780
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	11/09/2014	16	155160
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/09/2014	10	95275
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/09/2014	10	95275
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	15/09/2014	20	190950
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	18	171675
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	16/09/2014	2	19075
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	17/09/2014	10	97250
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	17/09/2014	10	97100

Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	17/09/2014	10	97075
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	25/09/2014	3	27682.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	25/09/2014	2	18455
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	25/09/2014	15	138412.5
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	25/09/2014	19	175275
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	25/09/2014	1	9225
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	5	45800
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	10	91600
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	1	9160
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	1	9160
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	1	9160
Vob Sözleşmesi	F_XU0301014S0	26/09/2014	2	18320
TOPLAM :			290	2801665

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