

Ocak 2015 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	1,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	4,025,446.43
F. KATILMA PAYI SAYISI:	928,071.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/08/1993
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	4.34
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	4.20
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.03
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.03
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.48
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	0.55
Varant	
Devlet Tahvili	0.02
Özel Sektör Tahvili	0.08
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	0.12

Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	0.20
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.03
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.01
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	1.89
Hisse Senedi	
Devlet Borçlanma Senetleri	0.98
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	55.87
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:	59,383.86

T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN  
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:

414,029.53

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKSEN	20,000.00	66,600.00	0.02
ANACM	32,096.38	64,513.72	0.02
AYEN	140,000.00	312,200.00	0.07
DYOBY	90,654.00	198,532.26	0.05
EREGL	0.77	3.39	-
ISFIN	100,000.30	103,000.31	0.02
ISMEN	129,869.00	163,634.94	0.04
KLGYO	0.26	0.30	-
MGROS	9,000.00	206,550.00	0.05
MNDRS	100,000.48	78,000.37	0.02
RYSAS	200,000.03	168,000.03	0.04
SELEC	40,000.00	89,600.00	0.02
SISE	0.71	2.72	-
SODA	0.77	4.03	-
TEKST	100,000.00	187,000.00	0.04
TKFEN	30,000.00	172,500.00	0.04
TRKCM	0.50	1.80	-
TSKB	120,000.30	244,800.61	0.06
VAKBN	20,000.00	114,400.00	0.03
YKGYO	30,000.00	71,700.00	0.02
TOPLAM :	1,161,623.50	2,241,044.48	0.53
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT130515T11	100,000.00	100,438.21	0.02
TOPLAM :	100,000.00	100,438.21	0.02

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

TRSPRMF81518	250,000.00	258,064.69	0.06
TRSZORNE1512	150,000.00	150,310.35	0.04
TOPLAM :	400,000.00	408,375.04	0.10

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_XU0300215S0	-	100.00	110.70	-
TOPLAM :	-	100.00	110.70	-

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:

TL	138,050.25	138,050.25	0.03
TOPLAM :	138,050.25	138,050.25	0.03
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
RRP TRT130515T11	57,039.82	57,039.82	0.01
RRP TRT210721T11	500,392.47	500,392.47	0.12
BPP	440,293.33	440,293.33	0.10
BPP	344,202.10	344,202.10	0.08
TOPLAM :	1,341,927.72	1,341,927.72	0.32
FON PORTFÖY DEĞERİ	3,141,601.47	4,229,835.70	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	4,229,835.70	1.05	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	10,572.30	0.00	
C. ALACAKLAR (+) :	39,104.58	0.01	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	-	-	
E. BORÇLAR (-) :	254,066.15	0.06	
FON TOPLAM DEĞERİ:	4,025,446.43		

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	
Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	13,206.67
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	42.60
37004Aracılık Komisyonu	3,119.31
37005Vergi, Resim ve Harçlar	29.90
37006Saklama Giderleri	75.68
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	335.93
37022Ödünç Menkul Kıy.İşlem Komisyon Gideri	6.42

37023VOB İşlemi Komisyonu	224.75
37097FİG Giderleri	0.33
<b>TOPLAM</b>	<b>17,041.59</b>

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		02/01/2015	824,000.00	824,000.00
Borsa Para Piyasası		02/01/2015	54,000.00	54,000.00
Borsa Para Piyasası		05/01/2015	824,000.00	824,000.00
Borsa Para Piyasası		06/01/2015	825,000.00	825,000.00
Borsa Para Piyasası		07/01/2015	824,000.00	824,000.00
Borsa Para Piyasası		08/01/2015	304,000.00	304,000.00
Borsa Para Piyasası		08/01/2015	523,000.00	523,000.00
Borsa Para Piyasası		09/01/2015	834,000.00	834,000.00
Borsa Para Piyasası		12/01/2015	71,000.00	71,000.00
Borsa Para Piyasası		12/01/2015	732,000.00	732,000.00
Borsa Para Piyasası		13/01/2015	818,000.00	818,000.00
Borsa Para Piyasası		14/01/2015	809,000.00	809,000.00
Borsa Para Piyasası		15/01/2015	640,000.00	640,000.00
Borsa Para Piyasası		15/01/2015	10,000.00	10,000.00
Borsa Para Piyasası		16/01/2015	815,000.00	815,000.00
Borsa Para Piyasası		19/01/2015	808,000.00	808,000.00
Borsa Para Piyasası		20/01/2015	289,000.00	289,000.00
Borsa Para Piyasası		20/01/2015	481,000.00	481,000.00
Borsa Para Piyasası		21/01/2015	806,000.00	806,000.00
Borsa Para Piyasası		22/01/2015	626,000.00	626,000.00

Borsa Para Piyasası		22/01/2015	176,000.00	176,000.00
Borsa Para Piyasası		23/01/2015	38,000.00	38,000.00
Borsa Para Piyasası		23/01/2015	731,000.00	731,000.00
Borsa Para Piyasası		26/01/2015	76,000.00	76,000.00
Borsa Para Piyasası		26/01/2015	190,000.00	190,000.00
Borsa Para Piyasası		26/01/2015	512,000.00	512,000.00
Borsa Para Piyasası		27/01/2015	778,000.00	778,000.00
Borsa Para Piyasası		28/01/2015	185,000.00	185,000.00
Borsa Para Piyasası		28/01/2015	605,000.00	605,000.00
Borsa Para Piyasası		29/01/2015	663,000.00	663,000.00
Borsa Para Piyasası		29/01/2015	121,000.00	121,000.00
Borsa Para Piyasası		30/01/2015	440,000.00	440,000.00
Borsa Para Piyasası		30/01/2015	344,000.00	344,000.00
TOPLAM :			16,776,000.00	16,776,000.00
Devlet Tahvili	TRT130515T11	09/01/2015	28,000.00	27,962.68
TOPLAM :			28,000.00	27,962.68
Hisse Senedi	ISCTR	02/01/2015	10,000.00	65,400.00
Hisse Senedi	TCELL	02/01/2015	5,000.00	71,750.00
Hisse Senedi	TKFEN	02/01/2015	10,000.00	58,700.00
Hisse Senedi	VAKBN	02/01/2015	20,000.00	99,200.00
Hisse Senedi	TKFEN	09/01/2015	10,000.00	59,400.00
Hisse Senedi	VAKBN	12/01/2015	20,000.00	109,400.00
Hisse Senedi	HALKB	13/01/2015	4,000.00	59,600.00
Hisse Senedi	VAKBN	13/01/2015	10,000.00	54,800.00
Hisse Senedi	VAKBN	13/01/2015	10,000.00	55,200.00
Hisse Senedi	AKSEN	14/01/2015	20,000.00	62,400.00
Hisse Senedi	TKFEN	14/01/2015	10,000.00	59,700.00
Hisse Senedi	VAKBN	14/01/2015	10,000.00	55,700.00
Hisse Senedi	VAKBN	14/01/2015	10,000.00	56,200.00
Hisse Senedi	HALKB	15/01/2015	5,000.00	74,500.00
Hisse Senedi	VAKBN	15/01/2015	20,000.00	112,000.00
Hisse Senedi	VAKBN	15/01/2015	10,000.00	56,200.00
Hisse Senedi	VAKBN	15/01/2015	10,000.00	56,500.00

Hisse Senedi	AKSEN	16/01/2015	20,000.00	65,000.00
Hisse Senedi	VAKBN	16/01/2015	20,000.00	112,000.00
Hisse Senedi	VAKBN	19/01/2015	20,000.00	112,400.00
Hisse Senedi	HALKB	20/01/2015	5,000.00	76,250.00
Hisse Senedi	VAKBN	20/01/2015	10,000.00	57,500.00
Hisse Senedi	DESPC	22/01/2015	5,000.00	14,250.00
Hisse Senedi	DESPC	22/01/2015	10,000.00	28,700.00
Hisse Senedi	ISCTR	22/01/2015	10,000.00	70,300.00
Hisse Senedi	SELEC	22/01/2015	25,000.00	57,250.00
Hisse Senedi	VAKBN	22/01/2015	20,000.00	115,200.00
Hisse Senedi	AKSEN	23/01/2015	30,000.00	102,000.00
Hisse Senedi	AKSEN	23/01/2015	10,000.00	34,300.00
Hisse Senedi	RYSAS	23/01/2015	50,000.00	44,500.00
Hisse Senedi	TSKB	26/01/2015	20,000.00	43,000.00
Hisse Senedi	TSKB	26/01/2015	20,000.00	43,200.00
Hisse Senedi	RYSAS	27/01/2015	50,000.00	44,500.00
Hisse Senedi	AKSEN	28/01/2015	20,000.00	69,000.00
Hisse Senedi	YKGYO	28/01/2015	5,000.00	11,650.00
Hisse Senedi	YKGYO	28/01/2015	5,000.00	11,700.00
Hisse Senedi	YKGYO	28/01/2015	5,000.00	11,800.00
Hisse Senedi	SELEC	29/01/2015	10,000.00	23,200.00
Hisse Senedi	YKGYO	29/01/2015	5,000.00	11,950.00
TOPLAM :			569,000.00	2,326,300.00
Özel Sektör Tahvili	TRSZORNE1512	09/01/2015	150,000.00	153,974.88

#### 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	TRT130515T11	15/01/2015	28,000.00	27,999.75
TOPLAM :			28,000.00	27,999.75
Devlet Tahvili Repo	TRT070115T13	05/01/15-06/01/15	293,760.00	294,000.00

Devlet Tahvili Repo	TRT200219T11	06/01/15-07/01/15	433,315.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT210721T11	06/01/15-07/01/15	63,850.00	88,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT110320T18	07/01/15-08/01/15	507,465.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240724T15	07/01/15-08/01/15	18,160.00	20,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240724T15	07/01/15-08/01/15	63,550.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT020823T11	08/01/15-09/01/15	422,770.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	08/01/15-09/01/15	87,995.00	87,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT100719T18	09/01/15-12/01/15	477,640.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	09/01/15-12/01/15	109,530.00	106,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	12/01/15-13/01/15	145,540.00	141,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT210721T11	12/01/15-13/01/15	369,170.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	13/01/15-14/01/15	102,090.00	99,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	13/01/15-14/01/15	36,095.00	35,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200219T11	13/01/15-14/01/15	437,730.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT180924T11	14/01/15-15/01/15	505,970.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270116T18	14/01/15-15/01/15	84,195.00	86,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT111120T18	15/01/15-16/01/15	511,300.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	15/01/15-16/01/15	200,050.00	194,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	16/01/15-19/01/15	211,445.00	205,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	16/01/15-19/01/15	218,665.00	212,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	19/01/15-20/01/15	384,595.00	384,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	20/01/15-21/01/15	237,960.00	231,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT161215T19	20/01/15-21/01/15	132,370.00	120,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT161215T19	21/01/15-22/01/15	29,740.00	27,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT161215T19	21/01/15-22/01/15	2,205.00	2,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT181115T18	21/01/15-22/01/15	438,430.00	400,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT161215T19	22/01/15-23/01/15	221,445.00	201,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT161215T19	22/01/15-23/01/15	220,345.00	200,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	23/01/15-26/01/15	194,695.00	189,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	26/01/15-27/01/15	440,185.00	442,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT161215T19	27/01/15-28/01/15	14,285.00	13,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270319T13	27/01/15-28/01/15	446,845.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	28/01/15-29/01/15	359,880.00	500,000.00

Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	28/01/15-29/01/15	51,890.00	52,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	29/01/15-30/01/15	15,420.00	15,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT181115T18	29/01/15-30/01/15	546,355.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130515T11	30/01/15-02/02/15	58,595.00	57,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT210721T11	30/01/15-02/02/15	375,830.00	500,000.00
TOPLAM :			9,471,355.00	9,970,000.00
Hisse Senedi	AKSEN	09/01/2015	20,000.00	61,400.00
Hisse Senedi	TKFEN	12/01/2015	10,000.00	58,800.00
Hisse Senedi	VAKBN	12/01/2015	20,000.00	107,800.00
Hisse Senedi	AYEN	13/01/2015	10,000.00	20,900.00
Hisse Senedi	AYEN	13/01/2015	20,000.00	42,000.00
Hisse Senedi	HALKB	14/01/2015	4,000.00	59,000.00
Hisse Senedi	TKFEN	14/01/2015	20,000.00	117,600.00
Hisse Senedi	TKFEN	14/01/2015	10,000.00	59,400.00
Hisse Senedi	VAKBN	14/01/2015	10,000.00	55,200.00
Hisse Senedi	VAKBN	14/01/2015	10,000.00	55,400.00
Hisse Senedi	VAKBN	15/01/2015	60,000.00	334,800.00
Hisse Senedi	AYEN	16/01/2015	10,000.00	20,800.00
Hisse Senedi	ISMEN	16/01/2015	9,869.00	11,842.80
Hisse Senedi	ISMEN	16/01/2015	50,000.00	60,500.00
Hisse Senedi	VAKBN	16/01/2015	20,000.00	111,400.00
Hisse Senedi	AYEN	20/01/2015	30,000.00	63,000.00
Hisse Senedi	ISMEN	20/01/2015	50,000.00	61,000.00
Hisse Senedi	TSKB	20/01/2015	20,000.00	41,400.00
Hisse Senedi	ISMEN	22/01/2015	20,000.00	24,800.00
Hisse Senedi	AYEN	23/01/2015	20,000.00	43,600.00
Hisse Senedi	AYEN	23/01/2015	30,000.00	65,700.00
Hisse Senedi	AYEN	26/01/2015	20,000.00	45,400.00
Hisse Senedi	RYSAS	27/01/2015	50,000.00	42,500.00
Hisse Senedi	YKGYO	27/01/2015	20,000.00	45,000.00
Hisse Senedi	YKGYO	28/01/2015	20,000.00	45,000.00
Hisse Senedi	YKGYO	28/01/2015	10,000.00	22,600.00
Hisse Senedi	RYSAS	29/01/2015	50,000.00	43,000.00

Hisse Senedi	TSKB	29/01/2015	40,000.00	83,600.00
Hisse Senedi	VAKBN	30/01/2015	20,000.00	114,200.00
TOPLAM :			683,869.00	1,917,642.80
Özel Sektör Tahvili	TRSZORNE1512	15/01/2015	150,000.00	154,276.07
Özel Sektör Tahvili	TRSPRMF81518	23/01/2015	60,000.00	61,716.18
TOPLAM :			210,000.00	215,992.25

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
ISCTR	15/01/2015	19/01/2015	10,000.00	66,700.00
VAKBN	15/01/2015	19/01/2015	10,000.00	55,400.00
TOPLAM :			20,000.00	122,100.00
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			-	-