

Eylül 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:	3,358,251.50			
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	0.030489			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.031691			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-3.79%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	7.82%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1.81%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	47.72%			
Varant				
Devlet Tahvili	48.17%			
Özel Sektör Tahvili				
Finansman Bonosu				
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	2.69%			
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	1.42%			
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:	47.63%			
Hisse Senedi				
Devlet Borçlanma Senetleri	75.76%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	3,120.44			
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:	0			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	0			

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:			
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	4,500.35	33,392.60	0.96%
AKENR	55,000.19	60,500.21	1.74%
AKFGY	80,000.00	96,000.00	2.77%
AKSEN	13,058.00	32,122.68	0.93%
ALBRK	40,000.00	65,600.00	1.89%
ANACM	14,978.31	24,414.65	0.70%
BIZIM	2,250.00	41,737.50	1.20%
BNKTR	5,000.00	67,400.00	1.94%
CRDFA	22,500.00	39,150.00	1.13%
EKGYO	40,000.00	95,200.00	2.74%
HALKB	11,000.00	150,700.00	4.34%
HALKB	2,500.00	34,250.00	0.99%
INDES	30,000.00	147,000.00	4.24%
ISCTR	7,500.00	37,950.00	1.09%
MGROS	5,900.00	108,855.00	3.14%
RYSAS	0.06	0.04	0.00%
SAHOL	9,000.00	86,220.00	2.48%
SNGYO	60,000.00	50,400.00	1.45%
TCELL	3,000.00	35,700.00	1.03%
THYAO	22,500.00	145,575.00	4.19%
TKFEN	10,000.00	50,600.00	1.46%
TRKCM	15,612.67	39,812.31	1.15%
VAKBN	32,000.00	135,040.00	3.89%
YKBNK	27,000.00	120,690.00	3.48%
TOPLAM :	513,299.58	1,698,309.98	48.93%
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT071015T12	20,000.00	20,588.71	0.59%
TRT080524T17	400,000.00	426,864.60	12.30%

TRT200324T13	200,000.00	218,110.00	6.28%	
TRT240724T15	400,000.00	387,204.60	11.16%	
TRT261022T10	400,000.00	476,916.00	13.74%	
TRT270923T11	100,000.00	98,341.44	2.83%	
TOPLAM :	1,520,000.00	1,628,025.35	46.91%	
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	49,370.46	49,370.46	1.42%	

TOPLAM :	49,370.46	49,370.46	1.42%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
RRP TRT150715T17	95,024.86	95,024.86	2.74%
TOPLAM :	95,024.86	95,024.86	2.74%
FON PORTFÖY DEĞERİ	2,177,694.90	3,470,730.65	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	3,470,730.65	103.35%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	13,034.01	0.39%	
C. ALACAKLAR (+) :	2,552.73	0.08%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :	128,065.89	3.81%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	3,358,251.50		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	10,376.20		
37002Denetim Ücreti	193.5		
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	39.84		
370032ON RRP Tahvil Borsa Payı	27.79		
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	18.85		
37004Aracılık Komisyonu	493.46		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	20.7		
37006Saklama Giderleri	46.48		
TOPLAM	11,216.82		
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
Devlet Tahvili	TRT200324T13	05/09/2014	100,000.00	114,307.14
Devlet Tahvili	TRT200324T13	11/09/2014	100,000.00	113,828.57
Devlet Tahvili	TRT240216T10	19/09/2014	200,000.00	205,752.20
Devlet Tahvili	TRT240216T10	24/09/2014	100,000.00	102,973.08
Devlet Tahvili	TRT240216T10	25/09/2014	100,000.00	102,922.47
TOPLAM :			600,000.00	639,783.46
Hisse Senedi	AKSEN	05/09/2014	7,000.00	19,950.00
Hisse Senedi	AKBNK	08/09/2014	6,000.00	50,700.00
Hisse Senedi	GARAN	17/09/2014	4,000.00	33,840.00
Hisse Senedi	GARAN	22/09/2014	10,000.00	82,700.00
Hisse Senedi	GARAN	24/09/2014	5,000.00	41,000.00
Hisse Senedi	TCELL	24/09/2014	4,000.00	47,600.00
Hisse Senedi	TTKOM	26/09/2014	5,000.00	29,550.00
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	TRT240216T10	05/09/2014	100,000.00	102,754.56
Devlet Tahvili	TRT270923T11	09/09/2014	100,000.00	102,848.90
Devlet Tahvili	TRT071015T12	11/09/2014	20,000.00	20,576.87
Devlet Tahvili	TRT240724T15	19/09/2014	100,000.00	99,687.91
Devlet Tahvili	TRT240724T15	19/09/2014	100,000.00	99,917.91
Devlet Tahvili	TRT240724T15	24/09/2014	100,000.00	99,611.54
Devlet Tahvili	TRT240724T15	25/09/2014	100,000.00	99,276.26
TOPLAM :			620,000.00	624,673.95

Devlet Tahvili Repo	TRT150715T17	01/09/14-02/09/14	162,000.00	145,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	02/09/14-03/09/14	102,474.00	145,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	03/09/14-04/09/14	127,520.00	125,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	04/09/14-05/09/14	127,250.00	125,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	05/09/14-08/09/14	136,480.00	135,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270116T18	08/09/14-09/09/14	138,005.00	135,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	09/09/14-10/09/14	55,425.00	55,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	10/09/14-11/09/14	50,735.00	50,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	11/09/14-12/09/14	105,840.00	142,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	11/09/14-12/09/14	3,075.00	3,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	12/09/14-15/09/14	111,925.00	110,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	15/09/14-16/09/14	117,635.00	115,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	16/09/14-17/09/14	118,335.00	115,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	17/09/14-18/09/14	111,800.00	110,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	18/09/14-19/09/14	91,275.00	90,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	19/09/14-22/09/14	70,155.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	22/09/14-23/09/14	71,440.00	70,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	23/09/14-24/09/14	62,085.00	60,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT190815T12	24/09/14-25/09/14	16,755.00	15,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT190815T12	25/09/14-26/09/14	22,335.00	20,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT020823T11	26/09/14-29/09/14	57,130.00	65,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	29/09/14-30/09/14	67,930.00	65,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150715T17	30/09/14-01/10/14	105,350.00	95,000.00
TOPLAM :			2,032,954.00	2,060,000.00
Hisse Senedi	MGROS	01/09/2014	900	17,640.00
Hisse Senedi	YKBNK	08/09/2014	10,000.00	50,400.00
Hisse Senedi	GARAN	10/09/2014	4,000.00	33,680.00
Hisse Senedi	EKGYO	16/09/2014	10,000.00	26,200.00
Hisse Senedi	AKBNK	17/09/2014	4,500.00	35,595.00
Hisse Senedi	CRDFA	17/09/2014	10,000.00	18,300.00
Hisse Senedi	CRDFA	19/09/2014	5,000.00	9,050.00
Hisse Senedi	GARAN	22/09/2014	10,000.00	81,600.00
Hisse Senedi	TCELL	22/09/2014	4,000.00	48,000.00
Hisse Senedi	CRDFA	24/09/2014	2,500.00	4,475.00

Hisse Senedi	GARAN	24/09/2014	5,000.00	41,500.00
Hisse Senedi	EKGYO	29/09/2014	20,000.00	45,800.00
Hisse Senedi	HALKB	30/09/2014	2,500.00	34,125.00
Hisse Senedi	TCELL	30/09/2014	3,000.00	36,000.00
TOPLAM :			91,400.00	482,365.00
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0