

Mayıs 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:	2,712,951.53
F. KATILMA PAYI SAYISI:	619,552.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/08/1993
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	4.38
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	4.40
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI: -	0.00
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.04
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.29
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	0.50
Varant	
Devlet Tahvili	0.12
Özel Sektör Tahvili	0.10
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	0.07

Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	0.11
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.10
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:	0.12
Hisse Senedi	
Devlet Borçlanma Senetleri	0.66
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	96.74
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:	17,740.12

T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:

13,105.55

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	10,000.00	79,300.00	0.03
AKFGY	50,000.00	74,000.00	0.03
AKSEN	20,000.00	58,400.00	0.02
ANACM	0.38	0.77	-
AYEN	30,000.00	73,500.00	0.03
BTCIM	21,667.00	156,002.40	0.06
DYOBY	60,000.00	108,000.00	0.04
EREGL	0.77	3.30	-
GARAN	10,000.00	84,300.00	0.03
ISCTR	20,000.00	113,200.00	0.04
ISFIN	0.30	0.30	-
KLGYO	0.26	0.31	-
MGROS	5,000.00	110,000.00	0.04
MNDRS	0.48	0.27	-
MUTGG	858.00	36,044.58	0.01
RYSAS	150,000.03	129,000.03	0.05
SISE	0.71	2.53	-
SODA	0.77	4.60	-
TKFEN	20,000.00	93,800.00	0.03
TRKCM	0.50	1.55	-
TSKB	40,000.30	82,800.62	0.03
VAKBN	20,000.00	92,000.00	0.03
YKGYO	30,000.00	52,200.00	0.02
TOPLAM :	487,529.50	1,342,561.25	0.49

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

TRT150715T17	300,000.00	296,805.57	0.11
TOPLAM :	300,000.00	296,805.57	0.11

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

TRSBEDS41611	80,000.00	80,736.57	0.03
TRSPRMF81518	200,000.00	202,115.43	0.07
TRSZORNE1512	50,000.00	50,843.55	0.02
TOPLAM :	330,000.00	333,695.55	0.12

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	745,547.23	745,547.23	0.27
TOPLAM :	745,547.23	745,547.23	0.27

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:

FON PORTFÖY DEĞERİ	1,863,076.73	2,718,609.60
--------------------	--------------	--------------

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	2,718,609.60	1.00
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	394.83	0.00
C. ALACAKLAR (+) :	2,506.96	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	-	-
E. BORÇLAR (-) :	8,559.86	0.00
FON TOPLAM DEĞERİ:	2,712,951.53	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	7,662.14
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	39.59
37004Aracılık Komisyonu	122.97
37005Vergi, Resim ve Harçlar	76.70
37006Saklama Giderleri	68.69
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	123.46
37097FİG Giderleri	0.44
TOPLAM	8,093.99

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

04/05/2015

530,000.00

530,000.00

Borsa Para Piyasası

05/05/2015

543,000.00

543,000.00

Borsa Para Piyasası

07/05/2015

531,000.00

531,000.00

Borsa Para Piyasası

11/05/2015

527,000.00

527,000.00

Borsa Para Piyasası

12/05/2015

542,000.00

542,000.00

Borsa Para Piyasası

13/05/2015

525,000.00

525,000.00

Borsa Para Piyasası

14/05/2015

528,000.00

528,000.00

Borsa Para Piyasası

15/05/2015

55,000.00

55,000.00

Borsa Para Piyasası

15/05/2015

483,000.00

483,000.00

Borsa Para Piyasası

20/05/2015

541,000.00

541,000.00

Borsa Para Piyasası

21/05/2015

539,000.00

539,000.00

Borsa Para Piyasası

22/05/2015

535,000.00

535,000.00

TOPLAM :

5,879,000.00

5,879,000.00

Hisse Senedi

AYEN

13/05/2015

20,000.00

46,200.00

Hisse Senedi

AYEN

13/05/2015

10,000.00

23,300.00

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü

İtfa Tarihi

Nominal

TRT130515T11

13/05/2015

326,000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR:

Menkul Kıymet Türü

İhraççı Kurum

Alış Tarihi-G.D.Tarihi

Nominal

Alış Değeri

Devlet Tahvili

TRT150715T17

12/05/2015

300,000.00

295,338.00

TOPLAM :

300,000.00

295,338.00

Devlet Tahvili Repo

TRT140218T10

04/05/15-05/05/15

331,880.00

302,000.00

Devlet Tahvili Repo	TRT140218T10	05/05/15-06/05/15	340,895.00	308,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	06/05/15-07/05/15	334,845.00	321,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	07/05/15-08/05/15	334,110.00	321,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	08/05/15-11/05/15	337,325.00	324,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	11/05/15-12/05/15	323,530.00	311,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	13/05/15-14/05/15	147,620.00	204,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	13/05/15-14/05/15	103,480.00	143,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050220T17	14/05/15-15/05/15	16,380.00	15,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT130716T18	14/05/15-15/05/15	336,250.00	332,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT170615T16	15/05/15-18/05/15	21,795.00	22,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT170615T16	15/05/15-18/05/15	283,280.00	286,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT161116T19	18/05/15-20/05/15	310,510.00	308,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050220T17	20/05/15-21/05/15	46,550.00	43,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240118T19	20/05/15-21/05/15	164,190.00	163,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	21/05/15-22/05/15	151,385.00	208,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT210721T11	22/05/15-25/05/15	15,900.00	21,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT210721T11	22/05/15-25/05/15	143,070.00	189,000.00
TOPLAM :			3,742,995.00	3,821,000.00
Hisse Senedi	TKFEN	13/05/2015	20,000.00	97,800.00
TOPLAM :			20,000.00	97,800.00
Özel SektÖr Tahvili	TRSBEDS41611	20/05/2015	50,000.00	50,290.73
Özel SektÖr Tahvili	TRSPRMF81518	20/05/2015	50,000.00	50,293.01
TOPLAM :			100,000.00	100,583.74

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:

Verilen Ödünçler

TOPLAM :

Alınan Ödünçler

TOPLAM :

İşlem Tarihi

Vade Tarihi

Nominal

Tutar

-

-

-

-