

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON

Aralık 2018

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	200,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	2,933,963.80
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	2,673,745.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	2 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.097324
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.076633
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.92
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	2.12
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.54
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	19.67
f-) TPP	:	35.85
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	37.24
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	5.70
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	1.333
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.17
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1.00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
T.REPO				
TRT120619T17	02/01/19	2,823,245.00	2,501,739.12	85.17
TOPLAM:		2,823,245.00	2,501,739.12	85.17
TPP				
TPP	02/01/19	268,364.92	268,185.99	9.13
TOPLAM:		268,364.92	268,185.99	9.13

VOB Nakit Teminatı

		167,489.03	167,489.03	5.70
TOPLAM:		167,489.03	167,489.03	5.70
PORTFÖY DEĞERİ:		3,259,098.95	2,937,414.14	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	2,937,414.14	100.12 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,877.47	0.20 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-9,327.81	-0.32 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	2,933,963.80	
		100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	807.46	0.0275 %
Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	2,307.94	0.0787 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve	491.94	0.0168 %
İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	146.79	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	768.10	0.0262 %

Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	38.91	0.0013 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	-311.06	-0.0106 %
Diğer Harcamalar	0.04	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	227.54	0.0078 %
TOPLAM:	4,477.66	0.1527 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA				
Sirketin Unvanı	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ				
Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	0.000	0.00	74,157.000	79,999.83

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-30.11.2018 Risk Bildirim Tablosu				
Fon Portföy Değeri	2,939,333.40			
Fon Toplam Değeri	2,935,797.55			
Risk Değeri	2			
Fon Portföyü Standart Sapması	0.10			
Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi				
Açık Pozisyon Tutarı				
Kaldıraç Oranı		Limit : 5.00		
RMD Özeti				
	Fon			Limit
RMD	7,015.26			
RMD (%)	0.24			5.59
Beklenen Kayıp	8,058.81			
Beklenen Kayıp (%)	0.27			
Uç Değer Adedi	2			
RMD Kırılımı				
Piyasa	Büüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Takasbank Para Piyasası	268,186	640	0.02	
Teminat	167,489	400	0.01	
Ters Repo	2,501,739	5,975	0.20	