

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**Haziran 2019****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	:	6,104,303.70
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	5,113,784.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.193696
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.168504
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	2.16
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	8.78
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.41
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	90.82
f-) TPP	:	6.78
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	1.99
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	2.593
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.03
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	:	0.00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
T.REPO				
TRT020823T11	01/07/19	3,089,670.00	5,510,849.32	90.22
	TOPLAM:	3,089,670.00	5,510,849.32	90.22
TPP				
TPP	01/07/19	475,919.42	475,919.42	7.79
	TOPLAM:	475,919.42	475,919.42	7.79
VOB Nakit Teminatı				
		121,836.76	121,836.76	1.99

TOPLAM:	121,836.76	121,836.76	1.99
PORTFÖY DEĞERİ:	3,687,426.18	6,108,605.50	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	6,108,605.50	100.07 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,329.40	0.09 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-9,631.20	-0.16 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	6,104,303.70	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	982.09	0.0161 %
Fon Yönetim Ücreti	4,762.12	0.0780 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	291.48	0.0048 %
Kayda Alma Ücreti	305.22	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1,057.83	0.0173 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	48.17	0.0008 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	660.23	0.0108 %
Diğer Harcamalar	0.02	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	73.88	0.0012 %
TOPLAM:	8,181.04	0.1340 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	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	460,317.000	542,759.10	0.000	0.00

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-28.06.2019 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	6,088,621.62	
Fon Toplam Değeri	6,086,154.83	
Risk Değeri	2	
Fon Portföyü Standart Sapması	0.12	

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı		
Kaldıraç Oranı		Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	16,596.09			
RMD (%)	0.27			5.59
Beklenen Kayıp	19,064.83			
Beklenen Kayıp (%)	0.31			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	475,919	1,293	0.02
Teminat	121,837	331	0.01
Ters Repo	5,510,849	14,972	0.25