

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**Ağustos-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	:	8,898,596.76
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	7,167,571.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.241508
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.222858
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.53
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	13.14
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	23.37
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	86.34
f-) TPP	:	2.72
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	4.27
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	6.67
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	3.433
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
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				
TRT050624T19	02/09/19	8,027,965.00	8,016,876.71	90.01
	TOPLAM:	8,027,965.00	8,016,876.71	90.01
TPP				
TPP	02/09/19	321,670.14	321,670.14	3.61
	TOPLAM:	321,670.14	321,670.14	3.61
VOB Nakit Teminatı				
		568,720.82	568,720.82	6.38

TOPLAM:	568,720.82	568,720.82	6.38
PORTFÖY DEĞERİ:	8,918,355.96	8,907,267.67	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	8,907,267.67	100.10 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,228.41	0.06 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-13,899.32	-0.16 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	8,898,596.76	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1,417.18	0.0159 %
Fon Yönetim Ücreti	7,475.31	0.0840 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	333.12	0.0037 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1,182.08	0.0133 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	123.75	0.0014 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	755.12	0.0085 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	32.28	0.0004 %
TOPLAM:	11,318.84	0.1272 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE 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	0.000	0.00	1,356,061.000	1,662,998.63

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-29.08.2019 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	8,884,447.07
Fon Toplam Değeri	8,877,828.62
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.11

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	23,360.98			
RMD (%)	0.26			5.59
Beklenen Kayıp	26,836.03			
Beklenen Kayıp (%)	0.30			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	321,670	844	0.01
Teminat	568,721	1,492	0.02
Ters Repo	8,016,877	21,026	0.24