

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON

Kasım 19

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	:	62,303,458.91
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	48,364,928.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.288195
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.271220
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.34
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	17.39
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	19.65
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.93
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	97.51
f-) TPP	:	0.48
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	1.08
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	21.893
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.26
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%
---------	------	---------------	--------------	-------

HİSSE SENETLERİ

FROTO		10,000.00	638,000.00	1.01
TOPLAM:		10,000.00	638,000.00	1.01

T.REPO

TRT080328T15	02/12/19	19,417,575.00	19,522,037.67	31.00
TRT080328T15	02/12/19	19,417,575.00	19,522,037.67	30.99
TRT080328T15	02/12/19	19,417,575.00	19,522,037.67	30.99
TRT120128T11	02/12/19	418,080.00	500,565.07	0.80
TRT120128T11	02/12/19	418,080.00	500,565.07	0.79
TRT120128T11	02/12/19	418,080.00	500,565.07	0.80
TRT120128T11	02/12/19	1,254,235.00	1,501,695.21	2.38
TOPLAM:		60,761,200.00	61,569,503.43	97.75

TPP

TPP	02/12/19	170,185.14	170,185.14	0.27
TOPLAM:		170,185.14	170,185.14	0.27

VOB Nakit Teminatı

		613,664.83	613,664.83	0.97
TOPLAM:		613,664.83	613,664.83	0.97
PORTFÖY DEĞERİ:		61,555,049.97	62,991,353.40	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
----------	-------	-------

A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	62,991,353.40	101.10 %
B-)HAZIR DEĞERLER	4,425.94	0.01 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-692,320.43	-1.11 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	62,303,458.91	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	10,412.59	0.0167 %
Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	47,696.41	0.0766 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan	322.71	0.0005 %
Giderleri		
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri	4,134.27	0.0066 %
İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	126.88	0.0002 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen	737.56	0.0012 %
Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	0.02	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	328.77	0.0005 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	26.68	0.0000 %
TOPLAM:	63,785.89	0.1023 %

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	786,484.000	1,008,453.21	8,715,061.000	11,174,069.01

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-29.11.2019 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	58,517,820.54
Fon Toplam Değeri	58,481,009.63
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.12

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	178,150.54			
RMD (%)	0.30			5.59
Beklenen Kayıp	204,651.20			
Beklenen Kayıp (%)	0.35			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	170,185	296	0.00
Teminat	613,665	1,067	0.00
Ters Repo	61,569,503	99,101	0.17
Hisse	638,000	3,041	0.01
Futures	-27,850	58,373	0.10
Nakit	27,850	0	0.00

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	2,870,150	58,373	0.10
F_USDTRY1219	2,870,150	58,373	0.10