

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON

A-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	:	106,664,704.03
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	81,995,678.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.300858
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.288195
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.98
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	18.55
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	18.55
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.62
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	97.81
f-) TPP	:	0.24
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	1.33
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	31.827
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.62
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	02/01/20	10,501,120.00	10,506,472.60	9.84
TRT070727T13	02/01/20	382,725.00	500,308.22	0.47
TRT080328T15	02/01/20	5,841,940.00	6,003,698.63	5.62
TRT100124T17	02/01/20	5,765,150.00	6,504,006.85	6.09
TRT110226T13	02/01/20	14,661,050.00	14,008,630.14	13.12
TRT120820T12	02/01/20	8,448,825.00	9,505,856.16	8.91
TRT210421T14	02/01/20	4,461,105.00	5,003,082.19	4.69
TRT220921T18	02/01/20	20,255,815.00	19,512,020.55	18.29
TRT230222T13	02/01/20	6,335,630.00	13,508,321.92	12.65
TRT261022T10	02/01/20	6,733,290.00	13,508,321.92	12.65
TRT280628T18	02/01/20	5,567,975.00	6,504,006.85	6.09
TOPLAM:		88,954,625.00	105,064,726.03	98.42

TPP

TPP	02/01/20	41,024.15	41,024.15	0.04
TOPLAM:		41,024.15	41,024.15	0.04

VOB Nakit Teminatı

		1,642,996.34	1,642,996.34	1.54
TOPLAM:		1,642,996.34	1,642,996.34	1.54

PORTFÖY DEĞERİ:		90,638,645.49	106,748,746.52	100.00
-----------------	--	---------------	----------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	106,748,746.52	100.08 %
B-)HAZIR DEĞERLER	4,468.44	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-88,510.93	-0.08 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	106,664,704.03	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	16,967.52	0.0159 %
Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	71,164.04	0.0667 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve	312.30	0.0003 %
İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	5,333.24	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri	5,661.29	0.0053 %
İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	49.76	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen	663.27	0.0006 %
Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	-0.12	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	22.95	0.0000 %
TOPLAM:	100,174.25	0.0938 %

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

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	3,927,766.000	5,080,428.91	37,558,516.000	48,644,599.02

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

Fon Portföy Değeri	89,698,881.03
Fon Toplam Değeri	91,908,942.98
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.07

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	172,166.07			
RMD (%)	0.19			5.59
Beklenen Kayıp	197,776.51			
Beklenen Kayıp (%)	0.22			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	41,024	66	0.00
Teminat	1,642,996	2,650	0.00
Ters Repo	105,064,726	169,450	0.18