

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**E-2020****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	:	17,223,093.60
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	12,533,576.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.374156
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.359512
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.08
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	5.63
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	8.10
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.24
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	68.47
e-)Devlet Tahvili Repo	:	16.36
f-) TPP	:	1.12
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.01
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	12.80
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	6.404
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.41
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	:	18.96

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
TURSG		35,000.00	196,700.00	1.14
	TOPLAM:	35,000.00	196,700.00	1.14
BORÇLANMA SENETLERİ				
Özel Sektör				
TRFDNZYA2018	18/12/20	2,000,000.00	1,978,737.39	11.48
TRFTEBK42114	22/04/21	5,000,000.00	4,963,530.18	28.79
TRSDZBK72139	14/07/21	5,000,000.00	5,033,428.02	29.18
	TOPLAM:	12,000,000.00	11,975,695.59	69.45

T.REPO

TRT160425T33	02/11/20	2,576,275.00	2,503,030.82	14.52
TOPLAM:		2,576,275.00	2,503,030.82	14.52

TPP

TPP	02/11/20	318,369.84	318,369.84	1.85
TOPLAM:		318,369.84	318,369.84	1.85

VOB Nakit Teminatı

		2,248,074.46	2,248,074.46	13.04
TOPLAM:		2,248,074.46	2,248,074.46	13.04
PORTFÖY DEĞERİ:		17,177,719.30	17,241,870.71	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	17,241,870.71	100.11 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,943.30	0.03 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-24,720.41	-0.14 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	17,223,093.60	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden	979.47	0.0057 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	15,352.01	0.0891 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	279.36	0.0016 %
Tescil ve İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	305.01	0.0018 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	3,450.15	0.0200 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	59.17	0.0003 %
Ödemeleri		
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	750.72	0.0044 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	-0.01	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	351.68	0.0020 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	20.88	0.0001 %
TOPLAM:	21,548.44	0.1250 %

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	702,464.000	960,274.23	0.000	0.00

**FON RİSK RAPORU**

30.10.2020

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon**Fon Bilgileri**

Fon Portföy Değeri	17,241,870.71
Fon Toplam Değeri	17,223,093.60
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.16

Fon RMD Trendi

Fon Portföyü Standart Sapması	0.16
-------------------------------	------

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

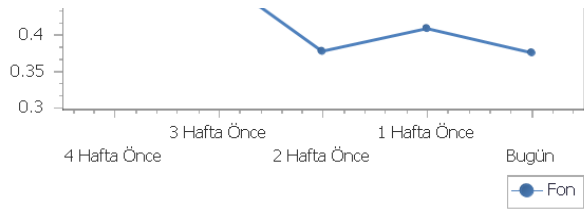
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	64,428.96			
RMD (%)	0.37			5.59
Beklenen Kayıp	74,013.04			
Beklenen Kayıp (%)	0.43			
Uç Değer Adedi	5			

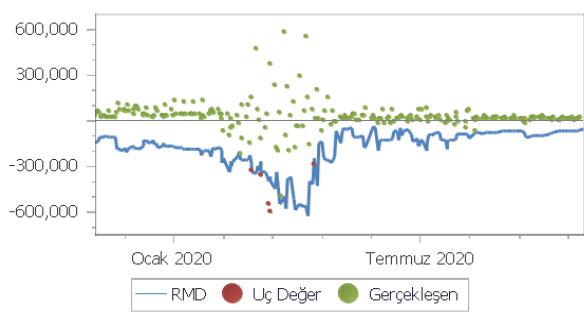
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	318,370	32	0.00
Teminat	2,248,074	178	0.00
Ters Repo	2,503,031	191	0.00
Hisse	196,700	2,914	0.02
Bono	11,975,696	47,872	0.28

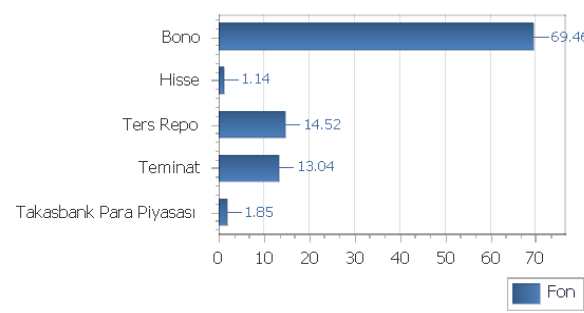
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
---------------------------	--------------------	-----------	---------------



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

