

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON

March 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	:	2,913,883.45
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	2,591,164.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	2 July 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.124546
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.102292
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	2.02
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	2.48
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.53
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	83.29
f-) TPP	:	11.05
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	4.13
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	1.251
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	2.16
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				
TRT140623T19	01/04/19	2,211,010.00	2,004,190.14	68.79
TOPLAM:		2,211,010.00	2,004,190.14	68.79
TPP				
TPP	01/04/19	793,692.49	793,692.49	27.24
TOPLAM:		793,692.49	793,692.49	27.24
VOB Nakit Teminatı				
		115,571.80	115,571.80	3.97
TOPLAM:		115,571.80	115,571.80	3.97
PORTFÖY DEĞERİ:		3,120,274.29	2,913,454.43	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	2,913,454.43	99.99 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,402.73	0.19 %

C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-4,973.71	-0.17 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	2,913,883.45	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	919.09	0.0315 %
Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	2,369.46	0.0813 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve	322.71	0.0111 %
İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	145.69	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	809.72	0.0278 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	48.09	0.0017 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen	728.82	0.0250 %
Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	161.01	0.0055 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	77.32	0.0027 %
TOPLAM:	5,581.91	0.1916 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE SENEDİ ALIM, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSİLİATINA 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	562,601.000	627,128.12	635,963.000	709,993.57

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-29.03.2019 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	2,801,225.30
Fon Toplam Değeri	2,804,882.49
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.10

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	7,119.03			
RMD (%)	0.25			5.59
Beklenen Kayıp	8,178.02			
Beklenen Kayıp (%)	0.29			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyükük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	793,692	1,939	0.07
Teminat	115,572	282	0.01
Ters Repo	2,004,190	4,897	0.17