

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON

Mayıs-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	:	6,513,358.87
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	5,574,101.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.168504
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.149437
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.66
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6.49
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	5.92
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	88.27
f-) TPP	:	3.98
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	1.83
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	2.790
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.06
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	:	3.68

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
TCELL		35,000.00	407,400.00	6.25
TOPLAM:		35,000.00	407,400.00	6.25
T.REPO				
TRT120820T12	07/06/19	1,470,305.00	1,503,121.83	23.06
TRT131119T19	07/06/19	4,299,300.00	4,008,324.88	61.50
TOPLAM:		5,769,605.00	5,511,446.71	84.56
TPP				
TPP	03/06/19	478,960.58	478,960.58	7.35
TOPLAM:		478,960.58	478,960.58	7.35
VOB Nakit Teminatı				
		119,915.03	119,915.03	1.84
TOPLAM:		119,915.03	119,915.03	1.84
PORTFÖY DEĞERİ:		6,403,480.61	6,517,722.32	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	6,517,722.32	100.07 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,198.83	0.08 %

C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-9,562.28	-0.15 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	6,513,358.87	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA

TUTAR

ORAN%

Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1,365.13	0.0210 %
Fon Yönetim Ücreti	5,661.97	0.0869 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	333.12	0.0051 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1,099.28	0.0169 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	123.38	0.0019 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	754.47	0.0116 %
Diğer Harcamalar	0.02	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	54.22	0.0008 %
TOPLAM:	9,391.59	0.1442 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE SENEDİ ALIM, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSILATINA 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	88,223.000	102,211.82	391,284.000	449,994.73

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-31.05.2019 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	6,484,145.67
Fon Toplam Değeri	6,481,220.60
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.15

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı

Kaldıraç Oranı

Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	22,600.92			
RMD (%)	0.35			5.59
Beklenen Kayıp	25,962.90			
Beklenen Kayıp (%)	0.40			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	478,961	789	0.01
Teminat	119,915	201	0.00
Ters Repo	5,511,447	5,560	0.09
Hisse	407,400	6,792	0.10