

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON

Eylül-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	:	34,058,719.32
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	27,021,307.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.260439
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.241508
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.52
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	14.86
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	22.36
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	8.07
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	87.62
f-) TPP	:	1.44
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.19
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	2.68
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	8.389
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.54
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				
EREGL		100,000.00	685,000.00	2.05
EREGL		50,000.00	342,500.00	1.03
PETKM		200,000.00	722,000.00	2.17
PETKM		-100,000.00	-361,000.00	-1.08
TCELL		100,000.00	1,301,000.00	3.90
TCELL		-30,000.00	-390,300.00	-1.17
TOPLAM:		320,000.00	2,299,200.00	6.90
T.REPO				
TRT020725T10	01/10/19	7,259,375.00	7,003,116.44	21.00
TRT050624T35	01/10/19	9,804,730.00	10,004,452.05	30.00
TRT100124T17	01/10/19	12,543,440.00	13,005,787.67	38.98
TOPLAM:		29,607,545.00	30,013,356.16	89.98
TPP				
TPP	01/10/19	482,198.08	482,198.08	1.45
TOPLAM:		482,198.08	482,198.08	1.45
VOB Nakit Teminatı				
		555,654.06	555,654.06	1.67
TOPLAM:		555,654.06	555,654.06	1.67
PORTFÖY DEĞERİ:		30,965,397.14	33,350,408.30	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	33,350,408.30	97.92 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,075.56	0.01 %
C-)ALACAKLAR	1,403,723.25	4.12 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-700,487.79	-2.06 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	34,058,719.32	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	7,513.04	0.0221 %
Fon Yönetim Ücreti	17,113.05	0.0502 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	301.89	0.0009 %
Kayda Alma Ücreti	1,702.94	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1,839.30	0.0054 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	61.81	0.0002 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	688.34	0.0020 %
Diğer Harcamalar	-0.11	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	42.79	0.0001 %
TOPLAM:	29,263.05	0.0859 %

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	0.000	0.00	19,853,736.000	24,831,447.99

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-30.09.2019 Risk Bildirim Tablosu				
Fon Portföy Değeri	24,873,901.21			
Fon Toplam Değeri	25,038,432.75			
Risk Değeri	2			
Fon Portföyü Standart Sapması	0.18			
Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi				
Açık Pozisyon Tutarı	1,693,110.00			
Kaldıraç Oranı	0.07			Limit : 5.00
RMD Özeti				
	Fon			Limit
RMD	138,909.29			
RMD (%)	0.55			5.59
Beklenen Kayıp	159,572.64			
Beklenen Kayıp (%)	0.64			
Uç Değer Adedi	0			
RMD Kırılımı				
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Takasbank Para Piyasası	482,198	898	0.00	
Teminat	555,654	1,034	0.00	
Ters Repo	30,013,356	47,119	0.19	
Hisse	2,299,200	23,727	0.09	
Futures	-19,860	29,825	0.12	
Nakit	19,860	0	0.00	
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Toplam	1,693,110	29,825	0.12	
F_USDTRY1019	1,693,110	29,825	0.12	