

**DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**  
**EKİM 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      | : | 51,403,508.48                        |
| G-)Tedavüldeki Pay Sayısı | : | 40,436,351.000                       |
| H-)Fonun Kuruluş Tarihi   | : | 02 Temmuz 2018                       |
| I-)Fonun Süresi           | : | Süresizdir.                          |

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

|                                      |   |          |
|--------------------------------------|---|----------|
| A-)Ay Sonu Pay Fiyatı                | : | 1.271220 |
| B-)Önceki Ay Pay Fiyatı              | : | 1.260439 |
| C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı      | : | 0.86     |
| D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı  | : | 15.85    |
| E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı     | : | 20.12    |
| F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi    | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 8.06     |
| b-)Hazine Bonosu                     | : | 0.00     |
| c-)Devlet Tahvili                    | : | 0.00     |
| d-) Özel Sektör Tahvili              | : | 0.00     |
| e-)Devlet Tahvili Repo               | : | 90.26    |
| f-) TPP                              | : | 0.49     |
| g-) Opsiyon                          | : | 0.00     |
| h-) Varant                           | : | 0.00     |
| i-)Değerli Maden                     | : | 0.00     |
| j-) Mevduat                          | : | 0.00     |
| k-) Katılım Hesabı                   | : | 0.00     |
| l-)Diğer                             | : | 1.19     |
| G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı      | : | 19.556   |
| H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 0.26     |
| 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% |
|------------------------|----------|---------------|---------------|-------|
| <b>HİSSE SENETLERİ</b> |          |               |               |       |
| EREGL                  |          | 50,000.00     | 327,000.00    | 0.64  |
| ISCTR                  |          | 300,000.00    | 1,740,000.00  | 3.38  |
| TOPLAM:                |          | 350,000.00    | 2,067,000.00  | 4.02  |
| <b>T.REPO</b>          |          |               |               |       |
| TRT030523T13           | 01/11/19 | 3,482,320.00  | 6,002,400.00  | 11.67 |
| TRT030523T13           | 01/11/19 | 3,482,320.00  | 6,002,400.00  | 11.67 |
| TRT050220T17           | 01/11/19 | 17,975,080.00 | 17,507,000.00 | 34.02 |
| TRT080323T10           | 01/11/19 | 16,814,255.00 | 14,005,600.00 | 27.22 |
| TRT240724T15           | 01/11/19 | 2,902,405.00  | 2,501,000.00  | 4.86  |
| TRT240724T15           | 01/11/19 | 2,902,405.00  | 2,501,000.00  | 4.86  |
| TOPLAM:                |          | 47,558,785.00 | 48,519,400.00 | 94.30 |
| <b>TPP</b>             |          |               |               |       |
| TPP                    | 01/11/19 | 269,097.65    | 269,097.65    | 0.52  |
| TOPLAM:                |          | 269,097.65    | 269,097.65    | 0.52  |

**VOB Nakit Teminatı**

|                 |               |               |        |
|-----------------|---------------|---------------|--------|
|                 | 594,265.70    | 594,265.70    | 1.16   |
| TOPLAM:         | 594,265.70    | 594,265.70    | 1.16   |
| PORTFÖY DEĞERİ: | 48,772,148.35 | 51,449,763.35 | 100.00 |

**IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU**

| AÇIKLAMA              | TUTAR         | ORAN%    |
|-----------------------|---------------|----------|
| A-)FON PORTFÖY DEĞERİ | 51,449,763.35 | 100.09 % |
| B-)HAZIR DEĞERLER     | 5,176.70      | 0.01 %   |
| C-)ALACAKLAR          | 0.00          | 0.00 %   |
| D-)DİĞER VARLIKLAR    | 0.00          | 0.00 %   |
| E-)BORÇLAR            | -51,431.57    | -0.10 %  |
| F-)İHTİYAT            | 0.00          | 0.00 %   |
| G-)VERGİ              | 0.00          | 0.00 %   |
| FON TOPLAM DEĞERİ     | 51,403,508.48 | 100,00 % |

**V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER**

| AÇIKLAMA                                                           | TUTAR     | ORAN%    |
|--------------------------------------------------------------------|-----------|----------|
| Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar     | 13,302.87 | 0.0259 % |
| Fon Yönetim Ücreti                                                 | 42,254.02 | 0.0822 % |
| Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri          | 322.71    | 0.0006 % |
| Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler | 3,483.75  | 0.0068 % |
| Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri                             | 49.64     | 0.0001 % |
| Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti               | 737.07    | 0.0014 % |
| Diğer Harcamalar                                                   | -0.09     | 0.0000 % |
| BİST KYD Ücreti                                                    | 556.38    | 0.0011 % |
| Otomatik BPP Faiz BSMV                                             | 32.47     | 0.0001 % |
| TOPLAM:                                                            | 60,738.82 | 0.1182 % |

**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         |
|---------------------------------------------------------------------|---------------|----------------|----------------|---------------|
| <b>VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ</b> |               |                |                |               |
| Döviz Cinsi                                                         | Alış Miktarı  | Alış Tutarı    | Satış Miktarı  | Satış Tutarı  |
| TL                                                                  | 5,249,327.000 | 6,635,428.36   | 18,664,371.000 | 23,533,740.13 |

**DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon-31.10.2019 Risk Bildirim Tablosu**

|                               |               |
|-------------------------------|---------------|
| Fon Portföy Değeri            | 52,745,636.24 |
| Fon Toplam Değeri             | 52,701,239.89 |
| Risk Değeri                   | 2             |
| Fon Portföyü Standart Sapması | 0.12          |

**Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi**

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| Açık Pozisyon Tutarı |              |
| Kaldıraç Oranı       | Limit : 5.00 |

**RMD Özeti**

|                | Fon        |  |  | Limit |
|----------------|------------|--|--|-------|
| RMD            | 143,923.28 |  |  |       |
| RMD (%)        | 0.27       |  |  | 5.59  |
| Beklenen Kayıp | 165,332.48 |  |  |       |

|                         |            |           |               |  |
|-------------------------|------------|-----------|---------------|--|
| Beklenen Kayıp (%)      | 0.31       |           |               |  |
| Uç Değer Adedi          | 1          |           |               |  |
| RMD Kırılımı            |            |           |               |  |
|                         |            |           |               |  |
| Piyasa                  | Büyüklik   | Artık RMD | Artık RMD (%) |  |
| Takasbank Para Piyasası | 269,098    | 409       | 0.00          |  |
| Teminat                 | 594,266    | 902       | 0.00          |  |
| Ters Repo               | 48,519,400 | 48,512    | 0.09          |  |
| Hisse                   | 2,067,000  | 42,922    | 0.08          |  |