

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**N-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	:	44,251,012.43
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	33,675,140.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.314056
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.293876
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.56
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.01
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	14.32
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	12.30
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	82.60
f-) TPP	:	0.58
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.15
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	4.37
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	19.109
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.10
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				
ISCTR		300,000.00	1,485,000.00	3.61
ISCTR		-150,000.00	-742,500.00	-1.80
VAKBN		200,000.00	906,000.00	2.20
VAKBN		-100,000.00	-453,000.00	-1.10
	TOPLAM:	250,000.00	1,195,500.00	2.91

T.REPO

TRT030523T13	04/05/20	10,289,705.00	20,019,726.03	48.60
TRT030523T13	04/05/20	9,003,495.00	17,517,260.27	42.54
	TOPLAM:	19,293,200.00	37,536,986.30	91.14

TPP

TPP	04/05/20	240,232.77	240,232.77	0.58
	TOPLAM:	240,232.77	240,232.77	0.58

VOB Nakit Teminatı

		2,210,680.50	2,210,680.50	5.37
	TOPLAM:	2,210,680.50	2,210,680.50	5.37
PORTFÖY DEĞERİ:		21,994,113.27	41,183,399.57	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	41,183,399.57	93.07 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1,664.85	0.00 %
C-)ALACAKLAR	3,119,000.00	7.05 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-53,051.99	-0.12 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	44,251,012.43	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	13,012.93	0.0294 %
Fon Yönetim Ücreti	44,494.34	0.1005 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	288.09	0.0007 %
Kayda Alma Ücreti	879.90	0.0020 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	5,213.96	0.0118 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	59.94	0.0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	742.17	0.0017 %
Diğer Harcamalar	-0.18	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	362.67	0.0008 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	23.46	0.0001 %
TOPLAM:	65,077.28	0.1471 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE 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	11,902,622.000	15,474,495.70	229,615.000	299,999.12



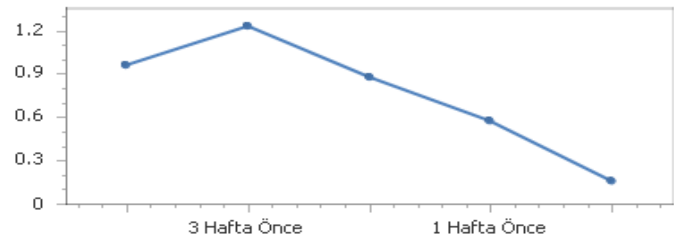
Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	41,183,399.57
Fon Toplam Değeri	44,251,012.43
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.07

FON RİSK RAPORU

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon

Fon RMD Trendi



Kaldırıcı Yaratan İşlemler Bilgisi

30.04.2020

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Özeti

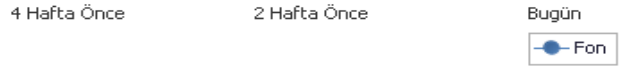
Açık Pozisyon Tutarı	795,862.43	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.05	Limit : 5.00

RMD Özeti

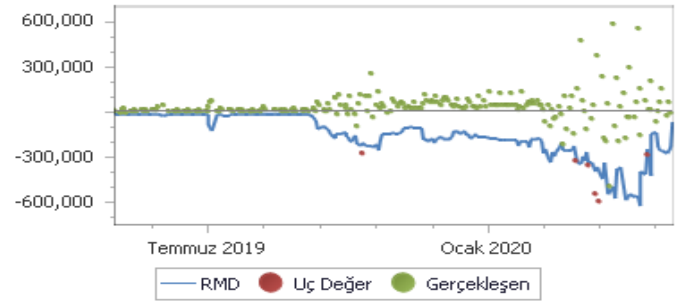
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	70,838.45			
RMD (%)	0.16			5.59
Beklenen Kayıp	81,375.97			
Beklenen Kayıp (%)	0.18			
Uç Değer Adedi	6			

RMD Kırılımı

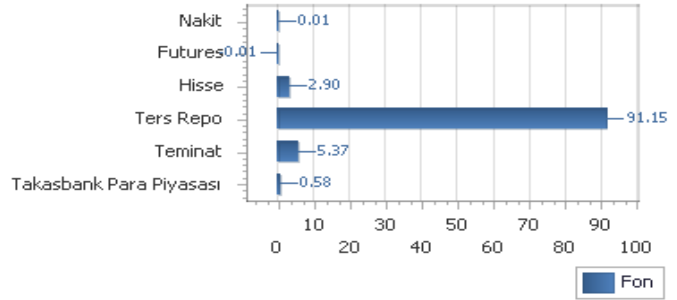
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	240,233	178	0.00
Teminat	2,210,681	1,614	0.00
Ters Repo	37,536,986	16,931	0.04
Hisse	1,195,500	-53,244	-0.12
Futures	-2,216	-17,902	-0.04
Nakit	2,216	0	0.00
Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-2,375,216	-17,902	-0.04
F_XU0300620	-2,375,216	-17,902	-0.04



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

