

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**E-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	:	17,994,560.06
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	13,236,040.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.359512
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.349884
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.71
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	4.51
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	7.86
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.37
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	49.46
e-)Devlet Tahvili Repo	:	38.91
f-) TPP	:	1.08
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	9.18
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	8.890
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.09
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	:	29.86

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
---------	------	---------------	--------------	-------

HİSSE SENETLERİ

TIRE		70,000.00	473,900.00	2.63
TURSG		35,000.00	198,800.00	1.10
TOPLAM:		105,000.00	672,700.00	3.73

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFDNZYA2018	18/12/20	2,000,000.00	1,964,079.47	10.90
TRFTEBK42114	22/04/21	5,000,000.00	4,952,140.76	27.49

TRSDZBK72139	14/07/21	5,000,000.00	5,037,156.60	27.95
	TOPLAM:	12,000,000.00	11,953,376.83	66.34

T.REPO

TRT170724T14	01/10/20	3,045,825.00	3,000,986.30	16.66
	TOPLAM:	3,045,825.00	3,000,986.30	16.66

TPP

TPP	01/10/20	165,056.73	165,056.73	0.92
	TOPLAM:	165,056.73	165,056.73	0.92

VOB Nakit Teminatı

		2,225,787.08	2,225,787.08	12.35
	TOPLAM:	2,225,787.08	2,225,787.08	12.35

PORTFÖY DEĞERİ:		17,541,668.81	18,017,906.94	100.00
-----------------	--	---------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	18,017,906.94	100.13 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,280.90	0.03 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-28,627.78	-0.16 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	17,994,560.06	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1,814.87	0.0101 %
Fon Yönetim Ücreti	19,769.00	0.1099 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	261.90	0.0015 %
Kayda Alma Ücreti	-307.76	-0.0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	3,696.57	0.0205 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	59.40	0.0003 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	706.32	0.0039 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	0.01	0.0000 %
Diğer Harcamalar	329.70	0.0018 %
BİST KYD Ücreti	24.78	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	26,354.79	0.1464 %
TOPLAM:		

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
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	10,502,834.000	14,221,989.98	0.000	0.00



Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	18,017,906.94
Fon Toplam Değeri	17,994,560.06
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.24

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

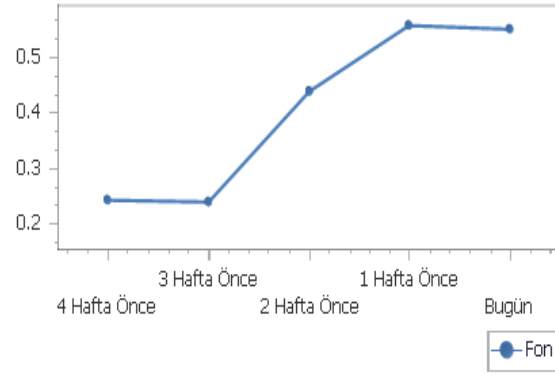
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	99,344.25			
RMD (%)	0.55			5.59
Beklenen Kayıp	114,122.13			
Beklenen Kayıp (%)	0.63			
Uç Değer Adedi	6			

RMD Kırılımı

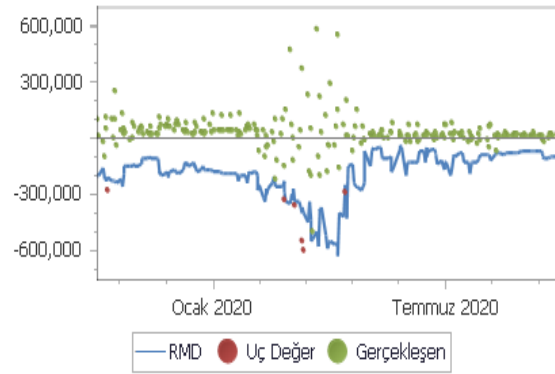
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	165,057	39	0.00
Teminat	2,225,787	505	0.00
Ters Repo	3,000,986	672	0.00
Hisse	672,700	10,529	0.06
Bono	11,953,377	52,280	0.29

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyükliği	Artık RMD	Artık RMD (%)
----------------------------	--------------------	-----------	---------------

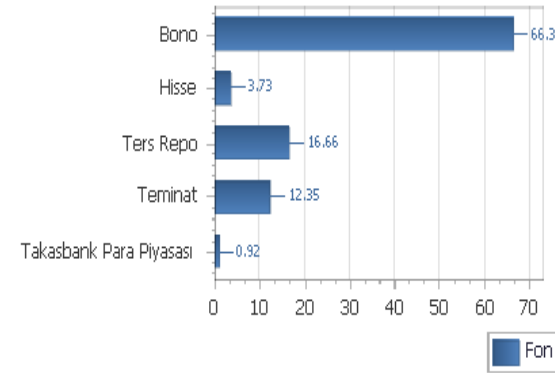
Fon RMD Trendi



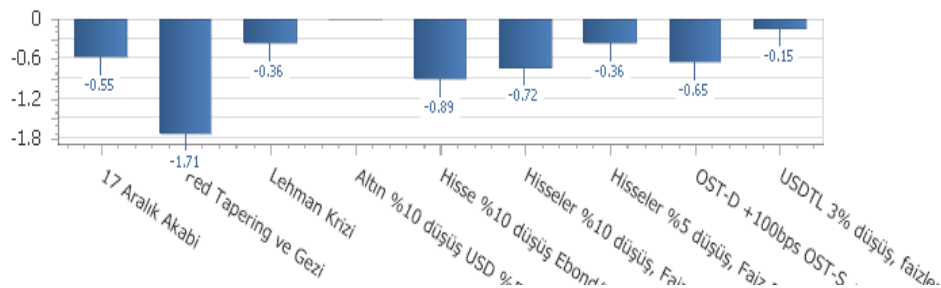
Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi



...er 50bps düşüş, hisse 5% artış
... +200bps
... 50 bps artış, TL %5 değer kaybı
... 100 bps artış, TL %10 değer kaybı
... SGMK +150 bps Fx %5 artış
.../Y Hisse %5 düşüş
...5 düşüş