

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**A-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	:	15,313,800.25
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	10,924,816.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Temmuz 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.401744
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.385354
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.18
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	7.76
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	7.76
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.58
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	70.45
e-)Devlet Tahvili Repo	:	9.36
f-) TPP	:	4.12
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	14.49
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	5.644
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.42
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				
AKSEN		35,000.00	260,400.00	1.65
MGROS		10,000.00	428,000.00	2.71
MGROS		5,000.00	214,000.00	1.35
TCELL		10,000.00	161,000.00	1.02
	TOPLAM:	60,000.00	1,063,400.00	6.73

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFTEBK42114	22/04/21	5,000,000.00	4,984,940.46	31.55
TRSDZBK72139	14/07/21	5,000,000.00	5,024,738.49	31.80

TOPLAM:	10,000,000.00	10,009,678.95	63.35
---------	---------------	---------------	-------

T.REPO

TRT160425T33	04/01/21	2,018,940.00	2,003,934.25	12.68
TOPLAM:		2,018,940.00	2,003,934.25	12.68

TPP

TPP	04/01/21	420,816.99	420,816.99	2.66
TOPLAM:		420,816.99	420,816.99	2.66

VOB Nakit Teminatı

		2,304,383.50	2,304,383.50	14.58
TOPLAM:		2,304,383.50	2,304,383.50	14.58
PORTFÖY DEĞERİ:		14,804,140.49	15,802,213.69	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	15,802,213.69	103.19 %
B-)HAZIR DEĞERLER	10,196.58	0.07 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-498,610.02	-3.26 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	15,313,800.25	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1,104.46	0.0072 %
Fon Yönetim Ücreti	14,615.15	0.0954 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	270.63	0.0018 %
Kayda Alma Ücreti	188.81	0.0012 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	3,378.65	0.0221 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	59.16	0.0004 %
Ödenen Denetim Ücreti	727.26	0.0047 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	0.02	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	340.69	0.0022 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	100.71	0.0007 %
TOPLAM:	20,785.54	0.1357 %

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	1,434,136.000	1,993,053.82	0.000	0.00



FON RİSK RAPORU

12.31.2020

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	15,802,213.69
--------------------	---------------

Fon RMD Trendi

0.4

Fon Toplam Değeri	15,313,800.25
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.16

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

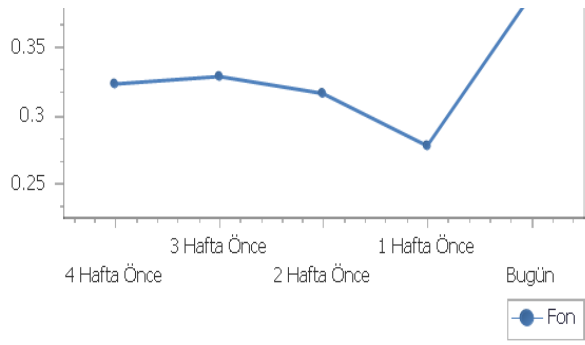
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	59,558.86			
RMD (%)	0.39			5.59
Beklenen Kayıp	68,418.50			
Beklenen Kayıp (%)	0.45			
Uç Değer Adedi	5			

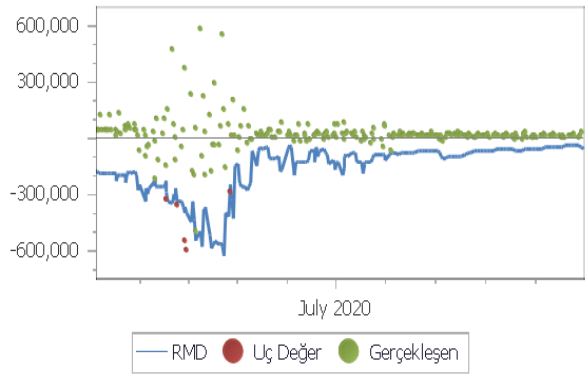
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	420,817	263	0.00
Teminat	2,304,384	1,360	0.01
Ters Repo	2,003,934	1,193	0.01
Hisse	1,063,400	14,783	0.10
Bono	10,009,679	22,314	0.15

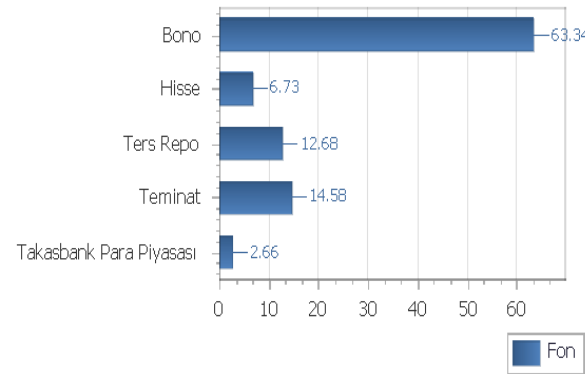
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
---------------------------	--------------------	-----------	---------------



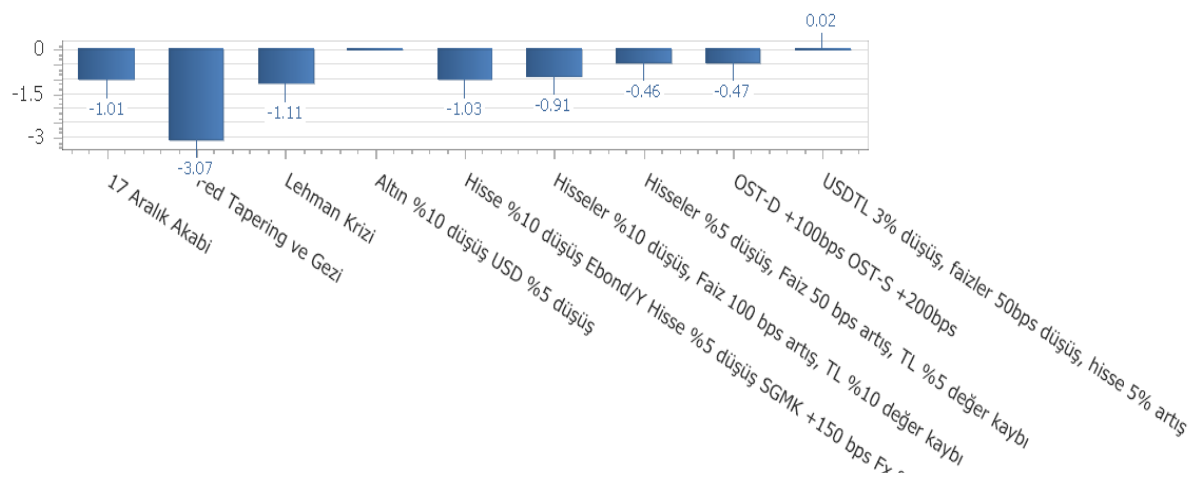
Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi



x %5 art5