

DDF-DENİZ PORTFÖY DİNAMO SERBEST FON**O-2021****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	:	15,509,138.17
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	:	1.419625
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.401744
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.28
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.28
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	8.15
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	6.49
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	49.94
e-)Devlet Tahvili Repo	:	25.75
f-) TPP	:	2.85
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	14.97
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	5.462
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.57
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				
KOZAL		10,000.00	1,154,000.00	6.69
MGROS		15,000.00	662,100.00	3.84
MGROS		5,000.00	220,700.00	1.28
TCELL		20,000.00	318,800.00	1.85
TCELL		20,000.00	318,800.00	1.85
	TOPLAM:	70,000.00	2,674,400.00	15.51

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFTEBK42114	22/04/21	5,000,000.00	4,990,192.39	28.94

TOPLAM:	5,000,000.00	4,990,192.39	28.94
---------	--------------	--------------	-------

T.REPO

TRT110226T13	01/02/21	7,520,015.00	7,009,780.82	40.64
TOPLAM:		7,520,015.00	7,009,780.82	40.64

TPP

TPP	01/02/21	194,271.87	194,271.87	1.13
TOPLAM:		194,271.87	194,271.87	1.13

VOB Nakit Teminatı

		2,376,718.29	2,376,718.29	13.78
TOPLAM:		2,376,718.29	2,376,718.29	13.78
PORTFÖY DEĞERİ:		15,161,005.16	17,245,363.37	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	17,245,363.37	111.19 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,507.06	0.04 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-1,741,732.26	-11.23 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	15,509,138.17	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	4,580.91	0.0295 %
Fon Yönetim Ücreti	11,852.85	0.0764 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	244.44	0.0016 %
Kayda Alma Ücreti	248.48	0.0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	3,382.05	0.0218 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	64.50	0.0004 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	658.44	0.0042 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	-0.05	0.0000 %
Diğer Harcamalar	307.72	0.0020 %
BİST KYD Ücreti	55.50	0.0004 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	21,394.84	0.1379 %
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
-------------	--------------	-------------	---------------	--------------



FON RİSK RAPORU

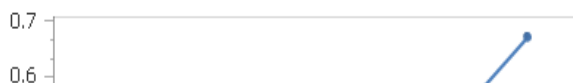
29.01.2021

DDF - Deniz Portföy Dinamo Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	17,245,363.37
Fon Toplam Değeri	15,509,138.17

Fon RMD Trendi



Risk Deęeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.26

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Ağık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.10	Limit : 5.00

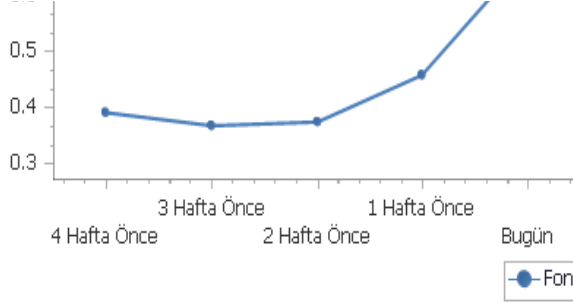
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelı	Limit
RMD	103,972.74			
RMD (%)	0.67			5.59
Beklenen Kayıp	119,439.13			
Beklenen Kayıp (%)	0.77			
Uç Deęer Adedi	5			

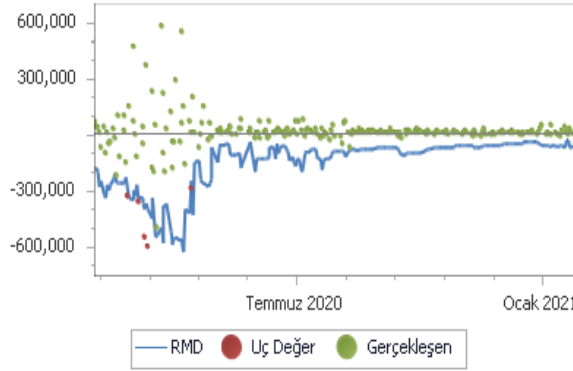
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyükük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	194,272	122	0.00
Teminat	2,376,718	1,443	0.01
Ters Repo	7,009,781	3,921	0.03
Hisse	2,674,400	45,706	0.29
Bono	4,990,192	5,746	0.04
Futures	8,130	-17,444	-0.11
Nakit	-8,130	0	0.00

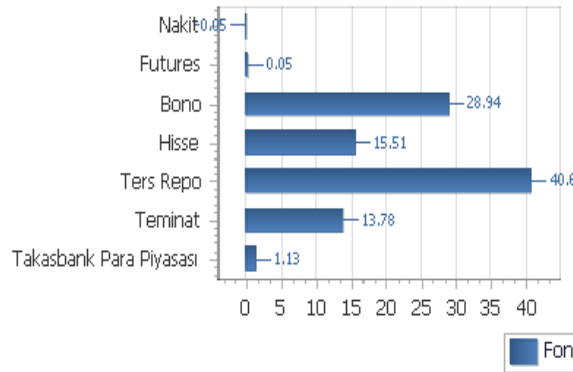
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyükükü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-1,572,370	-17,444	-0.11
F_XU0300221	-1,572,370	-17,444	-0.11



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

