

30/11/2015 Tarihli Aylık Raporudur.

Kasım 15

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	DENİZPORTFÖY DAMLA SERBEST ÖZEL FON
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	100,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	25,067,480.54
F. KATILMA PAYI SAYISI:	25,322,283.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	28.09.2015
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	0.989938	30.11.2015
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-1.01%	
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-1.03%	
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:		
Hisse Senedi		
Varant		
Devlet Tahvili	15.14%	
Özel Sektör Tahvili	13.41%	
Finansman Bonosu		
Banka Bonosu		
Hazine Bonosu		
Devlet Tahvili Repo	67.06%	
Kuponlar Repo		
Hazine Bonosu Repo		
Varlığa Dayalı Menkuller		
Kira Sertifikaları		
Katılım Hesabı		
Katılma Belgesi		
GES		
GOS		
Borsa Para Piyasası		
Kıymetli Madenler		
VOB İşlemleri		
VOB Nakit Teminat İşlemleri		
Yabancı Sabit Getirili		
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)		
Opsiyon İşlemleri	-0.15%	
Yabancı Hisse Senetleri		
Vadeli Mevduat TL	4.54%	
Vadeli Mevduat Döviz		
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.121	
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:		
Hisse Senedi	0.00%	
Devlet Borçlanma Senetleri	106.75%	
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1280.891	
J. AYLIK KORELASYON :		
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :		
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	25,099,999.02	
M. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	0	

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT120325T12	1,080,000.00	971,864.35	3.87%
TRT161215T19	300,000.00	298,784.84	1.19%
TRT240724T15	7,000,000.00	6,770,329.65	26.98%
TOPLAM :	8,380,000.00	8,040,978.84	32.05%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSKORT81714	2,000,000.00	2,021,906.00	8.06%
TRSKRDMK1713	4,000,000.00	4,015,753.60	16.01%
TRSKRSN51620	500,000.00	502,035.28	2.00%
TRSMETYA1518	190,000.00	196,366.61	0.78%

TRSZORF61614	160,000.00	165,682.72	0.66%
TRSZORFA1516	280,000.00	288,987.23	1.15%
TRSZORN81616	850,000.00	861,753.83	3.43%
TOPLAM :	7,980,000.00	8,052,485.26	32.09%

G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:

H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:

I) KİRA SERTİFİKALARI:

J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:

K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:

L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:

M) KATILIM HESAPLARI:

N) KATILMA BELGELERİ:

O) VOB İŞLEMLERİ:

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:

DENİZ EURTRY	-1,000,000.00	-73,689.36	-0.29%
DNZ USD/TL	-1,000,000.00	-18,501.68	-0.07%
USD/TRY 3.05	-1,000,000.00	-24,253.62	-0.10%
TOPLAM :	-3,000,000.00	-116,444.65	-0.46%

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:

VL Vadeli Mevduat TL	811,184.66	803445.34	0.03
VL Vadeli Mevduat TL	811,230.68	803459.44	0.03
VL Vadeli Mevduat TL	811,046.58	803403.00	0.03
RRP TRSLBTV71712	3,607,836.16	3606715.67	0.14
RRP TRSVERA31717	3,006,530.14	3,005,596.40	11.98%
RRP TRT010420T19	90,023.25	90,023.25	0.36%
TOPLAM :	9,137,851.47	9,112,643.10	36.32%

FON PORTFÖY DEĞERİ 22,497,851.47 25,089,662.54

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	25,089,662.54	100.09%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	2,176.14	0.01%
C. ALACAKLAR (+) :	0.01	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%
E. BORÇLAR (-) :	24,358.15	0.10%

FON TOPLAM DEĞERİ: 25,067,480.54 30.11.2015

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	1,033.41
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	9.00
3700320/N RRP Tahvil Borsa Payı	562.71
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	6.24
37005Vergi, Resim ve Harçlar	115.05
37006Saklama Giderleri	675.20
37012Portföy Yönetim Ücreti	1,033.19
37045Fon Saklama Ücreti	566.21
37099Diğer Giderler	1,252.27
TOPLAM	5,253.28

6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI.

TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA

İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama Nominal Değeri

7- PORFÖYDEN SATIŞLAR:

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal Değeri	Satış Değeri
TOPLAM :				

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü İtfa Tarihi Nom. (1000 TL)

9- PORFÖYE ALIŞLAR:

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nom. (1000 TL)	Al.Değ.(1000 TL)
TOPLAM :				

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00