

DENİZPORTFÖY DAMLA SERBEST ÖZEL FON - DDS

31/12/2015 Tarihli Aylık Raporudur.

Aralık 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:	25,069,822.97
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:	0.990914	31.12.2015
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.989938	
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.001000	
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-0.91%	
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.93%	
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:		

Hisse Senedi

Varant

Devlet Tahvili	30.42%
Özel Sektör Tahvili	33.50%

Finansman Bonosu

Banka Bonosu

Hazine Bonosu

Devlet Tahvili Repo	24.37%
---------------------	--------

Kuponlar Repo

Hazine Bonosu Repo

Varlığa Dayalı Menkuller

Kira Sertifikaları

Katılım Hesabı

Katılma Belgesi

GES

GOS

Borsa Para Piyasası	0.60%
---------------------	-------

Kıymetli Madenler

VOB İşlemleri

VOB Nakit Teminat İşlemleri

Yabancı Sabit Getirili

Euro Bond (Euro Tahvil Turk)

	1.88%
--	-------

Opsiyon İşlemleri	-0.68%
-------------------	--------

Yabancı Hisse Senetleri	0.28%
-------------------------	-------

Vadeli Mevduat TL	9.63%
-------------------	-------

Vadeli Mevduat Döviz

G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.253
----------------------------------	-------

H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
---------------------------------------	--

Hisse Senedi	0.00%
--------------	-------

Devlet Borçlanma Senetleri	17.86%
----------------------------	--------

I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1369.918
-------------------------------	----------

J. AYLIK KORELASYON :

K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :

L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN

KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	0.00
------------------------------	------

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	949,378.43	3.75%
TRT240724T15	7,000,000.00	6,694,174.90	26.46%
TOPLAM :	8,080,000.00	7,643,553.33	30.21%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSKORT81714	2,000,000.00	2,039,906.42	8.06%
TRSKRDMK1713	4,000,000.00	4,060,802.64	16.05%
TRSKRSNS1620	500,000.00	510,561.83	2.02%
TRSMPLCA1717	1,000,000.00	1,014,156.52	4.01%
TRSZORF61614	160,000.00	161,767.80	0.64%
TRSZORN81616	850,000.00	872,390.83	3.45%

TOPLAM :	8,510,000.00	8,659,586.04	34.23%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
XS1298711729	200,000.00	571,126.51	2.26%
US0378331005 - APPLE INC	250.00	77,721.99	0.31%
US30303M1027 - FB (FACEBOOK INC-A)	500.00	154,260.40	0.61%
TOPLAM :	200,750.00	803,108.89	3.17%
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
DENİZ EURTRY	-1,000,000.00	-113,881.48	-0.45%
USD/TRY 2.93	-1,000,000.00	-38,621.91	-0.15%
USD/TRY 3.05	-1,000,000.00	-7,816.41	-0.03%
TOPLAM :	-3,000,000.00	-160,319.79	-0.63%
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
S) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	824,630.32	811,791.04	3.21%
VL Vadeli Mevduat TL	825,117.17	811,856.78	3.21%
VL Vadeli Mevduat TL	824,636.61	811,659.42	3.21%
RRP TRSKRSNE1713	5,813,069.86	5,803,731.24	22.94%
BPP	113,185.75	113,046.41	0.45%
TOPLAM :	8,400,639.71	8,352,084.89	33.01%
FON PORTFÖY DEĞERİ	22,191,389.71	25,298,013.35	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	25,298,013.35	100.91%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	7,152.56	0.03%	
C. ALACAKLAR (+) :	0.04	0.00%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :	235,342.98	0.94%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	25,069,822.97	42,369.00	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	2,440.37		
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	15.31		
3700320/N RRP Tahvil Borsa Payı	0.49		
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	1,165.43		
37004Aracılık Komisyonu	468.03		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	59.80		
37006Saklama Giderleri	732.58		
37009Noter Tasdik ve Ücreti	99.08		
37012Portföy Yönetim Ücreti	2,439.84		
370141İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	236.00		
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	43.43		
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	1,253.50		
37041BBP Borsa Payı	31.20		
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	16.7		
37045Fon Saklama Ücreti	1,336.89		
37098Küsürat farkları	0.08		
37099Diğer Giderler	3,473.11		
TOPLAM	13,811.84		
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

Borsa Para Piyasası Satışı		04.12.2015	420,000.00	420,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		07.12.2015	784,000.00	784,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		07.12.2015	302,000.00	302,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		08.12.2015	86,000.00	86,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		09.12.2015	20,000.00	20,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		10.12.2015	25,000.00	25,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		11.12.2015	25,000.00	25,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		14.12.2015	25,000.00	25,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		16.12.2015	95,000.00	95,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		17.12.2015	95,000.00	95,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		18.12.2015	95,000.00	95,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		21.12.2015	95,000.00	95,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		22.12.2015	95,000.00	95,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		23.12.2015	307,000.00	307,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		24.12.2015	307,000.00	307,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		25.12.2015	308,000.00	308,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		28.12.2015	104,000.00	104,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		29.12.2015	104,000.00	104,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		30.12.2015	116,000.00	116,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		31.12.2015	113,000.00	113,000.00
TOPLAM :			3,521,000.00	3,521,000.00
Devlet Tahvili	TRT161215T19	04.12.2015	100,000.00	99,677.00
Devlet Tahvili	TRT161215T19	04.12.2015	200,000.00	199,354.00
TOPLAM :			300,000.00	299,031.00
Opsiyon	USD/TRY 2.93	15.12.2015	1,000,000.00	7,000.00
TOPLAM :			1,000,000.00	7,000.00
Özel Sektör Tahvili	TRSMETYA1518	04.12.2015	190,000.00	196,477.33
Özel Sektör Tahvili	TRSZORFA1516	04.12.2015	280,000.00	288,809.23
Özel Sektör Tahvili	TRSKRDMK1713	07.12.2015	300,000.00	301,849.90
TOPLAM :			770,000.00	787,136.46
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)
Devlet Tahvili Repo	TRT161116T19	01/12/15-02/12/15	93,060.00	88,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSKRSNE1713	02/12/15-09/12/15	7,339,510.00	6,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSVERA71713	02/12/15-09/12/15	857,255.00	700,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT080317T18	04/12/15-07/12/15	360,935.00	363,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSEKOF41715	09/12/15-16/12/15	2,942,560.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSNTHLA1618	09/12/15-16/12/15	2,892,510.00	2,900,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT080317T18	15/12/15-16/12/15	206,856.00	208,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSEKOF71613	16/12/15-23/12/15	2,936,735.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSULFK21719	16/12/15-23/12/15	2,981,950.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSDGOZ81719	23/12/15-30/12/15	5,704,465.00	5,800,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRSKRSNE1713	30/12/15-06/01/16	5,637,175.00	5,800,000.00
TOPLAM :			31,953,011.00	30,859,000.00
Euro Tahvil (Türk)	XS1298711729	07.12.2015	200,000.00	196,225.00
TOPLAM :			200,000.00	196,225.00
Forward	09/12/2015 VALÖRLÜ FWD USD ALIŞ	07.12.2015	200,000.00	200,000.00
Forward	22/01/2016 VALÖRLÜ FORWARD USD A	15.12.2015	1,000,000.00	1,000,000.00
Forward	SWAP USD/2.9659	15.12.2015	1,000,000.00	1,000,000.00
Forward	SWAP USD/2.9973	15.12.2015	2,000,000.00	2,000,000.00
Forward	SWAP EUR/3.2995	15.12.2015	500,000.00	500,000.00
Forward	28/12/2015 VALÖRLÜ FRW USD ALIŞ	25.12.2015	70,000.00	70,000.00
TOPLAM :			4,770,000.00	4,770,000.00
Özel Sektör Tahvili	TRSMPLCA1717	08.12.2015	1,000,000.00	1,000,000.00
Özel Sektör Tahvili	TRSKRDMK1713	09.12.2015	300,000.00	302,067.53
TOPLAM :			1,300,000.00	1,302,067.53
Vadeli Mevduat (TL)		30.12.2015	811,184.66	811,184.66
Vadeli Mevduat (TL)		30.12.2015	811,230.68	811,230.68
Vadeli Mevduat (TL)		30.12.2015	811,046.58	811,046.58
TOPLAM :			2,433,461.92	2,433,461.92
Yabancı Hisse	FB US	23.12.2015	500	52,855.90
Yabancı Hisse	AAPL	23.12.2015	250	26,975.00
TOPLAM :			750	79,830.90
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:				
Verilen Ödünçler	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
TOPLAM :				0
Alınan Ödünçler				0
TOPLAM :				0