

## DENİZPORTFÖY DAMLA SERBEST ÖZEL FON - DDS

29/02/2016 Tarihli Aylık Raporudur.

Şubat 16

## 1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	ENİZPORTFÖY 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:	25,014,289.29
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:	0.985988	23.02.2016
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.991006	
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.005100	
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-0.50%	
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-1.42%	
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:		

## Hisse Senedi

## Varant

Devlet Tahvili	24.31%
Özel Sektör Tahvili	34.00%
Finansman Bonosu	1.66%
Banka Bonosu	8.31%
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	13.04%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	5.89%
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	0.30%
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	2.25%
Opsiyon İşlemleri	-0.87%
Yabancı Hisse Senetleri	1.45%
Vadeli Mevduat TL	9.66%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.253
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	64.38%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	915.436
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:			
TRT240724T15	5,000,000.00	4,632,768.15	17.94%
TOPLAM :	5,000,000.00	4,632,768.15	17.94%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFDNFK41641	300,000.00	294,179.05	1.14%
TOPLAM :	300,000.00	294,179.05	1.14%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSKORT81714	2,000,000.00	2,010,633.10	7.79%
TRSKRDMK1713	4,000,000.00	4,007,640.84	15.52%
TRSKRSN51620	500,000.00	520,370.60	2.02%
TRSMPLCA1717	1,000,000.00	1,029,421.15	3.99%
TRSZORF61614	160,000.00	164,913.48	0.64%
TRSZORN81616	850,000.00	852,613.16	3.30%

TOPLAM :	8,510,000.00	8,585,592.33	33.26%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
XS1298711729	200,000.00	576,345.12	2.23%
US30303M1027 - FB (FACEBOOK INC-A)	500.00	156,840.56	0.61%
US88160R1014 - TESLA MOTORS	320.00	164,992.62	0.64%
US88160R1014 - TESLA MOTORS	280.00	144,368.54	0.56%
TOPLAM :	201,100.00	1,042,546.85	4.04%
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
EUROBOND BORÇ	115,458,000.00	1,505,456.86	5.83%
TOPLAM :	115,458,000.00	1,505,456.86	5.83%
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
DDS 5906	-1,000,000.00	-42,655.97	-0.17%
DDS EUR/TRY3.25	-1,000,000.00	-50,083.50	-0.19%
DDS EUR/USD1,10	1,000,000.00	50,329.82	0.19%
DDS EUR/USD1,13	-1,000,000.00	-18,651.48	-0.07%
DENİZ EURTRY	-1,000,000.00	-98,351.02	-0.38%
EUR/USD 1.11	-1,000,000.00	-6,217.51	-0.02%
EUR/USD 1.11	1,000,000.00	6,206.18	0.02%
USD 3.12 - 5976	1,000,000.00	0.88	0.00%
USD/TL 2.85	-1,000,000.00	-7,178.69	-0.03%
USD/TL 3.07	-500,000.00	-21.00	0.00%
USD/TRY 2.92	-1,000,000.00	-6,088.69	-0.02%
USD/TRY 3.12	-1,000,000.00	-0.88	0.00%
TOPLAM :	-5,500,000.00	-172,711.85	-0.67%
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	835,811.51	828,744.39	0.03
VL Vadeli Mevduat TL	835,240.65	828,229.74	0.03
VL Vadeli Mevduat TL	835,325.48	828,262.48	0.03
RRP TRSMLPCA1717	2,906,952.05	2,906,952.05	0.11
RRP TRSNTHLA1618	4,410,547.95	4,401,505.30	0.17
BPP	135,042.35	135,042.35	0.01
TOPLAM :	9,958,919.99	9,928,736.31	0.38
FON PORTFÖY DEĞERİ	133,928,019.99	25,816,567.71	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	25,816,567.71	103.21%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	2,863.33	0.01%	
C. ALACAKLAR (+) :	0.10	0.00%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :	805,141.85	3.22%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	25,014,289.29	23.02.2016	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	2,285.36		
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	113.96		
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	528.64		
37004Araçlık Komisyonu	1,780.72		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	113.61		
37006Saklama Giderleri	984.04		
37009Noter Tasdik ve Ücreti	258.92		
37012Portföy Yönetim Ücreti	2,284.91		
370141İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	236.00		
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	36.93		
37042Borsa Payı BSMV Karşılığı	8.51		
37045Fon Saklama Ücreti	1,251.99		
37098Küsurat farkları	-31.32		
37099Diğer Giderler	129.8		
TOPLAM	9,982.07		

6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI  
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI.  
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA

İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama

AAPL Tem:%36

Nominal Değeri

250

7- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü

İtfa Tarihi

Nom. (1000 TL)