

## Nisan 2016 Aylık Rapor

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:	25.026.669.80		
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:	0.988326	26/04/2016	
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.961182		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	2.82%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-0.26%		
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-1.19%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:			
Hisse Senedi			
Varant			
Devlet Tahvili	19.96%		
Özel Sektör Tahvili	34.16%		
Finansman Bonosu	4.89%		
Banka Bonosu			
Hazine Bonosu			
Devlet Tahvili Repo			
Kuponlar Repo			
Hazine Bonosu Repo			
Varlığa Dayalı Menkuller			
Kira Sertifikaları			
Katılım Hesabı			
Katılma Belgesi	6.01%		
GES			
GOS			
Borsa Para Piyasası	1.28%		
Kıymetli Madenler			
VOB İşlemleri			
VOB Nakit Teminat İşlemleri			
Yabancı Sabit Getiriler			
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)	21.13%		
Opsiyon İşlemleri	-1.17%		
Yabancı Hisse Senetleri	3.61%		
Vadeli Mevduat TL	10.13%		
Vadeli Mevduat Döviz			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	25.32%		
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:			
Hisse Senedi	0.00%		
Devlet Borçlanma Senetleri	37.02%		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,741.68		
J. AYLIK KORELASYON :			
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :			
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	0		
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 HAZINE BONOLARI:			
TRT240724T15	5,000,000.00	5,090,696.45	20.26%
TOPLAM :	5,000,000.00	5,090,696.45	20.26%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFDNFK81613	1,000,000.00	1,004,284.09	4.00%
TOPLAM :	1,000,000.00	1,004,284.09	4.00%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSKORT81714	2,000,000.00	2,071,268.78	8.24%
TRSKRDMK1713	2,000,000.00	2,052,394.02	8.17%
TRSKRSN51620	500,000.00	512,598.27	2.04%
TRSM LPC91814	1,000,000.00	1,017,729.64	4.05%
TRSM LPCA1717	1,000,000.00	1,020,293.79	4.06%
TRSZORF61614	160,000.00	163,109.13	0.65%
TRSZORF71712	1,000,000.00	1,003,341.59	3.99%
TRSZORN81616	850,000.00	873,282.38	3.48%
TOPLAM :	8,510,000.00	8,714,017.59	34.68%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			

J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
US900123CK49	500,000.00	1,470,148.37	5.85%	
XS1298711729	200,000.00	568,947.68	2.26%	
XS1376681067	500,000.00	1,548,634.11	6.16%	
XS1390320981	500,000.00	1,443,547.14	5.74%	
US02079K1079 - ALPHABET INC	70	143,624.68	0.57%	
US30303M1027 - FB (FACEBOOK INC-A)	1,350.00	422,044.44	1.68%	
US88160R1014 - TESLA MOTORS	600	428,801.40	1.71%	
TOPLAM :	1,702,020.00	6,025,747.82	23.98%	
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
EUROBOND BORÇ	115,458,000.00	1,510,306.10	6.01%	
TOPLAM :	115,458,000.00	1,510,306.10	6.01%	
O) VOB İŞLEMLERİ:				
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
DDS EUR/TRY3.25	-1,000,000.00	-48,278.41	-0.19%	
DENİZ EURTRY	-1,000,000.00	-7,037.65	-0.03%	
EUR 1.14 6092	-1,000,000.00	-31,926.27	-0.13%	
EUR 3.25 6029	1,000,000.00	48,190.99	0.19%	
EUR 3.40 6053	-1,000,000.00	-1,773.31	-0.01%	
EUR 3.45 6026	-1,000,000.00	-524.57	0.00%	
EUR 3.80 6028	-1,000,000.00	-43,783.99	-0.17%	
USD 2.95 6148	-1,000,000.00	-3,196.34	-0.01%	
USD 3 6149	-1,000,000.00	-11,292.58	-0.04%	
USD/TRY 2.86	-1,000,000.00	-40,698.27	-0.16%	
USD/TRY 2.88	-1,000,000.00	-44,970.03	-0.18%	
USD/TRY 3.20	-1,000,000.00	-104.73	0.00%	
USD/TRY 3.30	-1,000,000.00	-1,653.05	-0.01%	
USD2.90 6147	-1,000,000.00	-148.72	0.00%	
TOPLAM :	-12,000,000.00	-187,196.91	-0.74%	
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
VL Vadeli Mevduat TL	855,699.51	848,175.58	3.38%	
VL Vadeli Mevduat TL	854,740.25	847,343.85	3.37%	
VL Vadeli Mevduat TL	854,773.33	847,406.41	3.37%	
BPP	428,122.54	428,122.54	1.70%	
TOPLAM :	2,993,335.63	2,971,048.38	11.82%	
FON PORTFÖY DEĞERİ	122,663,355.63	25,128,903.53		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	25,128,903.53	100.41%		
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	90,647.78	0.36%		
C. ALACAKLAR (+) :	1,479.89	0.01%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	194,361.40	0.78%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	25,026,669.80	26/04/2016		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	2,421.36			
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	35			
37004Aracılık Komisyonu	1,977.95			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	207.44			
37006Saklama Giderleri	3,114.13			
37012Portföy Yönetim Ücreti	2,420.16			
370141IMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	590			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	109.4			
37033KAP Ücreti	764.46			
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	19.01			
37045Fon Saklama Ücreti	1,326.49			
TOPLAM	12,985.40			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nom. (1000 TL)		
TRFDNFK41641	22/04/2016	300,000.00		
7- ÖDÜNC İŞLEMLERİ:				
Verilen Ödünçler	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0