

Mayıs 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:	26,203,328.31		
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:	1.034793	31/05/2016	
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.988326		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	4.70%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	4.43%		
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	3.45%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YUZDESİ:			
Hisse Senedi	1.30%		
Varant			
Devlet Tahvili	20.59%		
Özel Sektör Tahvili	28.43%		
Finansman Bonosu	5.85%		
Banka Bonosu	3.05%		
Hazine Bonosu			
Devlet Tahvil Repo	0.80%		
Kuponlar Repo			
Hazine Bonosu Repo			
Varlığa Dayalı Menkuller			
Kira Sertifikaları			
Katılım Hesabı			
Katılma Belgesi	6.49%		
GES			
GOS			
Borsa Para Piyasası	7.79%		
Kıymetli Madenler			
VOB İşlemleri			
VOB Nakit Teminat İşlemleri			
Yabancı Sabit Getiriliiler			
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	1.24%		
Opsiyon İşlemleri	-2.07%		
Yabancı Hisse Senetleri	4.17%		
Vadeli Mevduat TL	10.69%		
Vadeli Mevduat Döviz	11.68%		
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	25.32%		
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:			
Hisse Senedi	100.24%		
Devlet Borçlanma Senetleri	72.95%		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	864.686		
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	Rayıç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
VIAGO	33,232.00	451,955.20	1.72%
TOPLAM :	33,232.00	451,955.20	1.72%
B) VARANLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT240724T15	5,000,000.00	4,925,922.90	18.76%
TOPLAM :	5,000,000.00	4,925,922.90	18.76%
D) BANKA BONOLARI:			
TRQDZBKK1619	2,000,000.00	2,007,542.66	7.64%
TOPLAM :	2,000,000.00	2,007,542.66	7.64%
E) FINANSMAN BONOLARI:			
TRFDNFK81613	1,000,000.00	1,006,786.13	3.83%
TRFVFAS91614	1,000,000.00	965,724.40	3.68%
TOPLAM :	2,000,000.00	1,972,510.53	7.51%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSKORT81714	2,000,000.00	2,022,976.30	7.70%
TRSKRDMK1713	1,000,000.00	1,004,896.09	3.83%
TRSKTMR51711	500,000.00	504,324.89	1.92%
TRSMPLC91814	1,000,000.00	1,032,305.04	3.93%
TRSZORF61614	160,000.00	165,261.50	0.63%
TRSZORF71712	1,000,000.00	1,003,628.95	3.82%
TRSZORN81616	750,000.00	754,006.57	2.87%
TOPLAM :	6,410,000.00	6,487,399.34	24.70%

G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
US02079K1079 - ALPHABET INC	70	151,300.09	0.58%	
US30303M1027 - FB (FACEBOOK INC-A)	1,350.00	477,031.72	1.82%	
US88160R1014 - TESLA MOTORS	600	396,096.67	1.51%	
TOPLAM :	2,020.00	1,024,428.47	3.90%	
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
EUROBOND BORÇ	115,458,000.00	1,562,724.03	5.95%	
TOPLAM :	115,458,000.00	1,562,724.03	5.95%	
O) VOB İŞLEMLERİ:				
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
EUR 1.14 6092	-1,000,000.00	-4,444.46	-0.02%	
EUR 3.80 6028	-1,000,000.00	-48,870.61	-0.19%	
EUR3.40 6283	-1,000,000.00	-35,361.32	-0.13%	
US 3.09 6274	-1,000,000.00	-10,569.29	-0.04%	
US 3.12 6273	-1,000,000.00	-15,727.81	-0.06%	
USD 2.88 6256	-1,000,000.00	-85,448.77	-0.33%	
USD 2.91 6257	-1,000,000.00	-77,871.88	-0.30%	
USD 3 6149	-1,000,000.00	-13,373.31	-0.05%	
USD/TRY 2.86	-1,000,000.00	-3,642.93	-0.01%	
USD/TRY 3.30	-1,000,000.00	-401.18	0.00%	
TOPLAM :	-10,000,000.00	-295,711.56	-1.13%	
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
VD Vadeli Mevduat Döviz	3,560.70	10,509.41	0.04%	
VL Vadeli Mevduat TL	870,940.78	858,268.72	3.27%	
VL Vadeli Mevduat TL	869,902.55	857,296.21	3.26%	
VL Vadeli Mevduat TL	869,936.21	857,329.41	3.26%	
BPP	4,873,481.62	4,873,481.62	18.56%	
BPP	669,203.45	669,203.45	2.55%	
TOPLAM :	8,157,025.31	8,126,088.82	30.94%	
FON PORTFÖY DEĞERİ	129,060,277.31	26,262,860.39		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutar	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	26,262,860.39	100.23%		
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	2,135.38	0.01%		
C. ALACAKLAR (+) :	28,750.52	0.11%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	90,417.98	0.35%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	26,203,328.31	31/05/2016		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	2,446.26			
37002Denetim Ücreti	632			
37004Aracılık Komisyonu	0.2			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	112.25			
37006Saklama Giderleri	1,759.72			
37012Portföy Yönetim Ücreti	2,445.72			
370141MKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	463.28			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	790.66			
37033KAP Ücreti	739.8			
37042Borsa Payı BSMV Karşılığı	165.01			
37045Fon Saklama Ücreti	1,340.14			
TOPLAM	10,895.04			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELİSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İfta Tarihi	Nom. (1000 TL)		
TRSKRSN51620	26/05/2016	500,000.00		
8- ÖDÜNC İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0