

Ağustos 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:	27.436.716.25		
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:	1.083501	31/08/2016	
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.057439		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	2.46%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	9.34%		
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	8.32%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:			
Hisse Senedi	1.82%		
Varant			
Devlet Tahvili	17.26%		
Özel Sektör Tahvili	22.51%		
Finansman Bonosu	7.99%		
Banka Bonosu	28.35%		
Hazine Bonosu			
Devlet Tahvili Repo	0.42%		
Kuponlar Repo			
Hazine Bonosu Repo			
Varlığa Dayalı Menkuller			
Kira Sertifikaları			
Katılım Hesabı			
Katılma Belgesi	5.90%		
GES			
GOS			
Borsa Para Piyasası	2.32%		
Kıymetli Madenler			
VOB İşlemleri			
VOB Nakit Teminat İşlemleri			
Yabancı Sabit Getiriler			
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)			
Opsiyon İşlemleri	-0.23%		
Yabancı Hisse Senetleri	3.91%		
Vadeli Mevduat TL	9.75%		
Vadeli Mevduat Döviz			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	25.32%		
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:			
Hisse Senedi	170.10%		
Devlet Borçlanma Senetleri	46.96%		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	489.269		
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			
GARAN	20,000.00	152,600.00	0.56%
ISCTR	45,000.00	216,450.00	0.79%
TOPLAM :	65,000.00	369,050.00	1.35%
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT240724T15	2,500,000.00	2,440,608.92	8.95%
TOPLAM :	2,500,000.00	2,440,608.93	8.95%
D) BANKA BONOLARI:			
TRQDZBK11719	2,000,000.00	1,925,617.54	7.06%
TRQDZBK11719	990,000.00	953,180.68	3.50%
TRQDZBKK1619	2,000,000.00	2,014,264.72	7.39%
TRQDZBKK1627	5,000,000.00	4,872,525.00	17.87%
TRQDZBKK1635	1,500,000.00	1,474,150.35	5.41%
TOPLAM :	11,490,000.00	11,239,738.29	41.23%
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFDNFKA1614	200,000.00	193,839.56	0.71%
TRFDNFKA1620	1,000,000.00	978,853.68	3.59%
TRFVFA91614	1,000,000.00	992,118.01	3.64%
TOPLAM :	2,200,000.00	2,164,811.25	7.94%

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:				
TRSKORT81714	2,000,000.00	2,013,781.08	7.39%	
TRSKRDMK1713	1,000,000.00	1,004,266.81	3.68%	
TRSKTMR51711	500,000.00	504,396.98	1.85%	
TRSMPLC91814	1,000,000.00	1,030,796.65	3.78%	
TRSZORF71712	1,000,000.00	1,013,436.59	3.72%	
TOPLAM :	5,500,000.00	5,566,678.11	20.42%	
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
US02079K1079 - ALPHABET INC	70	158,599.96	0.58%	
US30303M1027 - FB (FACEBOOK INC-A)	1,350.00	501,069.31	1.84%	
US88160R1014 - TESLA MOTORS	600	373,821.77	1.37%	
TOPLAM :	2,020.00	1,033,491.04	3.79%	
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
EUROBOND BORÇ	115,458,000.00	1,601,864.29	5.88%	
TOPLAM :	115,458,000.00	1,601,864.29	5.88%	
O) VOB İŞLEMLERİ:				
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
EUR 3.80 6028	-1,000,000.00	-9,330.77	-0.03%	
TOPLAM :	-1,000,000.00	-9,330.77	-0.03%	
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
VL Vadeli Mevduat TL	888,701.12	882,888.25	3.24%	
VL Vadeli Mevduat TL	890,009.56	884,137.95	3.24%	
VL Vadeli Mevduat TL	889,114.68	883,173.82	3.24%	
BPP	207,057.85	207,057.85	0.76%	
TOPLAM :	2,874,883.21	2,857,257.87	10.48%	
FON PORTFÖY DEĞERİ	139,089,903.21	27,264,169.01		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	27,264,169.01	99.37%		
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	3,213.91	0.01%		
C. ALACAKLAR (+) :	320,733.59	1.17%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	151,400.26	0.55%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	27,436,716.25	31/08/2016		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	2,653.93			
37002Denetim Ücreti	1,279.37			
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	156.65			
37004Aracılık Komisyonu	78.18			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	111.99			
37006Saklama Giderleri	896.73			
37012Portföy Yönetim Ücreti	2,653.34			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	317.37			
37033KAP Ücreti	309.38			
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	50.91			
37045Fon Saklama Ücreti	1,453.90			
TOPLAM	9,961.75			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nom. (1000 TL)		
TRFDNFK81613	05/08/2016	1,000,000.00		
TRSZORN81616	19/08/2016	750,000.00		
8- ÖDÜNC İŞLEMLERİ:				
Verilen Ödünçler	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
TOPLAM :			0	0

Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0