

Eylül 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:	27.738.676.75		
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:	1.095426	30/09/2016	
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.083501		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1.10%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	10.55%		
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	9.52%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:			
Hisse Senedi	0.30%		
Varant			
Devlet Tahvili	9.91%		
Özel Sektör Tahvili	20.82%		
Finansman Bonosu	11.99%		
Banka Bonosu	34.07%		
Hazine Bonosu			
Devlet Tahvili Repo	0.20%		
Kuponlar Repo			
Hazine Bonosu Repo			
Varlığa Dayalı Menkuller			
Kira Sertifikaları			
Katılım Hesabı			
Katılma Belgesi	5.81%		
GES			
GOS			
Borsa Para Piyasası	1.33%		
Kıymetli Madenler			
VOB İşlemleri			
VOB Nakit Teminat İşlemleri			
Yabancı Sabit Getiriler			
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)			
Opsiyon İşlemleri	-0.33%		
Yabancı Hisse Senetleri	6.52%		
Vadeli Mevduat TL	9.37%		
Vadeli Mevduat Döviz			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	25.32%		
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:			
Hisse Senedi	126.19%		
Devlet Borçlanma Senetleri	33.22%		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	585.105		
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 HAZİNE BONOLARI:			
TRT240724T15	2,500,000.00	2,467,041.23	8.93%
TRT270923T11	1,000,000.00	1,010,566.30	3.66%
TOPLAM :	3,500,000.00	3,477,607.53	12.59%
D) BANKA BONOLARI:			
TRQDZBK11719	2,900,000.00	2,816,265.72	10.20%
TRQDZBKK1627	5,300,000.00	5,233,575.31	18.95%
TOPLAM :	8,200,000.00	8,049,841.03	29.15%
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFDNFKA1614	200,000.00	195,679.05	0.71%
TRFDNFKA1630	2,000,000.00	1,964,444.56	7.11%
TRFDNFKA1620	1,000,000.00	988,328.49	3.58%
TOPLAM :	3,200,000.00	3,148,452.10	11.40%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSDZFK61711	250,000.00	231,454.53	0.84%
TRSKORT81714	2,000,000.00	2,033,575.52	7.36%
TRSKRDMK1713	1,000,000.00	1,014,801.66	3.67%
TRSKTMR51711	500,000.00	511,012.45	1.85%

TRSMPC91814		1,000,000.00	1,006,309.79	3.64%
TRSZORF71712		1,000,000.00	1,011,357.16	3.66%
TOPLAM :		5,750,000.00	5,808,511.11	21.03%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KIRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
US02079K1079 - ALPHABET INC	70		163,152.77	0.59%
US30303M1027 - FB (FACEBOOK INC-A)	1,350.00		518,508.01	1.88%
US30303M1027 - FB (FACEBOOK INC-A)	1,150.00		441,692.00	1.60%
US88160R1014 - TESLA MOTORS	600		363,717.43	1.32%
US88160R1014 - TESLA MOTORS	900		545,576.14	1.98%
TOPLAM :	4,070.00		2,032,646.36	7.36%
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
EUROBOND BORÇ		115,458,000.00	1,619,644.82	5.87%
TOPLAM :		115,458,000.00	1,619,644.82	5.87%
O) VOB İŞLEMLERİ:				
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
EUR 3.80 6028		-1,000,000.00	-7,816.85	-0.03%
USD 2.88 6544		-2,000,000.00	-13,490.33	-0.05%
USD 3.15 6556		-2,000,000.00	-67,249.06	-0.24%
USD 3.18 6582		-2,000,000.00	-75,478.04	-0.27%
TOPLAM :		-7,000,000.00	-164,034.29	-0.59%
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
VL Vadeli Mevduat TL		836,340.37	827,886.30	3.00%
VL Vadeli Mevduat TL		836,388.83	827,898.57	3.00%
VL Vadeli Mevduat TL		836,388.83	827,898.57	3.00%
BPP		1,158,918.47	1,158,918.47	4.20%
TOPLAM :		3,668,036.50	3,642,601.91	13.19%
FON PORTFÖY DEĞERİ		132,780,106.50	27,615,270.56	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı		%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:		27,615,270.56	99.56%	
B. HAZİR DEĞERLER (+) :		136,917.78	0.49%	
C. ALACAKLAR (+) :		2,520.72	0.01%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :		0	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :		16,032.31	0.06%	
FON TOPLAM DEĞERİ:		27,738,676.75	30/09/2016	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	2,782.70			
37002Denetim Ücreti	1,396.48			
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	53.73			
37004Aracılık Komisyonu	2,044.25			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	43.85			
37006Saklama Giderleri	1,106.92			
37012Portföy Yönetim Ücreti	2,782.08			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	125.12			
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	1,386.94			
37033KAP Ücreti	319.36			
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	18.76			
37045Fon Saklama Ücreti	1,524.48			
37099Diğer Giderler	11.81			
TOPLAM	13,596.48			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM.İ. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- PORFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal Değeri	Satış Değeri
Banka Bonosu	TRQDZBKK1635	09/09/2016	500,000.00	492,815.00
Banka Bonosu	TRQDZBKK1619	09/09/2016	2,000,000.00	2,006,000.00
Banka Bonosu	TRQDZBKK1635	26/09/2016	1,000,000.00	990,890.00
Banka Bonosu	TRQDZBK11719	26/09/2016	90,000.00	87,524.10
TOPLAM :			3,590,000.00	3,577,229.10

Borsa Para Piyasası Satışı		01/09/2016	207,000.00	207,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		02/09/2016	388,000.00	388,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		05/09/2016	402,000.00	402,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		06/09/2016	167,000.00	167,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		07/09/2016	167,000.00	167,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		08/09/2016	167,000.00	167,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		09/09/2016	147,000.00	147,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		16/09/2016	183,000.00	183,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		19/09/2016	183,000.00	183,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		20/09/2016	183,000.00	183,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		21/09/2016	183,000.00	183,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		22/09/2016	376,000.00	376,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		23/09/2016	81,000.00	81,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		26/09/2016	81,000.00	81,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		26/09/2016	877,000.00	877,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		26/09/2016	200,000.00	200,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		26/09/2016	1,000.00	1,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		27/09/2016	157,000.00	157,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		28/09/2016	157,000.00	157,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		29/09/2016	1,158,000.00	1,158,000.00
Borsa Para Piyasası Satışı		30/09/2016	1,158,000.00	1,158,000.00
TOPLAM :			6,623,000.00	6,623,000.00
Forward	07/10/2016 VLR FWD SATIŞ	22/09/2016	9,165,933.22	9,165,933.22
TOPLAM :			9,165,933.22	9,165,933.22
Hisse Senedi	GARAN	07/09/2016	20,000.00	162,000.00
Hisse Senedi	ISCTR	07/09/2016	45,000.00	217,350.00
TOPLAM :			65,000.00	379,350.00
Opsiyon	USD 2.88 6544	07/09/2016	2,000,000.00	11,800.00
Opsiyon	USD 3.15 6556	09/09/2016	2,000,000.00	21,200.00
Opsiyon	USD 3.18 6582	22/09/2016	2,000,000.00	22,200.00
TOPLAM :			6,000,000.00	55,200.00
8- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nom. (1000 TL)		
TRFVFAS91614	28/09/2016	1,000,000.00		
9- PORFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nom. (1000 TL)	Al.Değ.(1000 TL)
Banka Bonosu	TRQDZBKK1627	23/09/2016	300,000.00	295,536.00
TOPLAM :			300,000.00	295,536.00
Devlet Tahvili	TRT270923T11	26/09/2016	1,000,000.00	1,002,065.93
TOPLAM :			1,000,000.00	1,002,065.93
Devlet Tahvili Repo	TRT170221T12	28/09/16-29/09/16	939,894.00	1,000,000.00
TOPLAM :			939,894.00	1,000,000.00
Finansman Bonosu	TRFDNFKA1630	09/09/2016	2,000,000.00	1,950,400.00
TOPLAM :			2,000,000.00	1,950,400.00
Forward	07/10/2016 VLR FWD ALIŞ	26/09/2016	9,165,993.22	9,165,993.22
TOPLAM :			9,165,993.22	9,165,993.22
Özel Sektör Tahvili	TRSDZFK61711	06/09/2016	250,000.00	229,520.00
TOPLAM :			250,000.00	229,520.00
Vadeli Mevduat (TL)		22/09/2016	825,000.00	825,000.00
Vadeli Mevduat (TL)		22/09/2016	825,000.00	825,000.00
Vadeli Mevduat (TL)		22/09/2016	825,000.00	825,000.00
TOPLAM :			2,475,000.00	2,475,000.00
Yabancı Hisse	TSLA	07/09/2016	900	183,780.00
Yabancı Hisse	FB US	07/09/2016	1,150.00	151,029.50
TOPLAM :			2,050.00	334,809.50
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0