

DPB-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON**Ağustos 2018****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DPB-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	2,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	97,898,259.49
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	87,925,625.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.113421
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.106499
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.63
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	10.47
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	18.29
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.32
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) BPP	:	0.43
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.15
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.10
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	43.963
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1,523.50

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
---------	------	---------------	--------------	-------

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS0849728190	01/11/22	3,000,000.00	13,062,353.83	13.33
XS1003016018	10/11/23	200,000.00	821,432.90	0.84
XS1175854923	03/02/25	9,500,000.00	37,160,369.08	37.93
XS1376681067	09/03/26	1,000,000.00	4,528,664.08	4.62
XS1584113184	29/03/27	4,000,000.00	16,818,436.41	17.16
XS1772360803	27/04/28	1,000,000.00	4,081,726.02	4.17

XS1623796072	29/06/28	5,400,000.00	20,554,490.89	20.98
	TOPLAM:	24,100,000.00	97,027,473.21	99.03

MEVDUAT

Mevduat	03/09/18	87,189.61	571,144.92	0.58
	TOPLAM:	87,189.61	571,144.92	0.58

BPP

BPP	03/09/18	111,160.57	111,160.57	0.11
BPP	03/09/18	279,403.59	279,403.59	0.28
	TOPLAM:	390,564.16	390,564.16	0.39

PORTFÖY DEĞERİ:		24,577,753.77	97,989,182.29	100.00
-----------------	--	---------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	97,989,182.29	100.09 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,968.33	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-94,891.13	-0.10 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	97,898,259.49	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar Fon Yönetim Ücreti	159.56	0.0002 %
	84,847.87	0.0867 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	262.35	0.0003 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	7,508.12	0.0077 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	110.88	0.0001 %
Ödenen Denetim Ücreti	690.36	0.0007 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına		
Ödenen Denetim Ücreti	394.35	0.0004 %
BİST KYD Ücreti		
Otomatik BPP Faiz BSMV	63.26	0.0001 %
TOPLAM:	94,036.75	0.0962 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE SENEDİ ALIM, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
-------------	--------------	-------------	---------------	--------------

DPB - Deniz Portföy Birinci Serbest Fon-31.08.2018 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	97,989,182.29	
Fon Toplam Değeri	97,898,259.49	
Risk Değeri	6	
Fon Portföyü Standart Sapması	2.20	

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı		
Kaldıraç Oranı		Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	4,617,103.59			
RMD (%)	4.72			5.59
Beklenen Kayıp	4,791,296.11			
Beklenen Kayıp (%)	4.89			
Uç Değer Adedi	8			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyükük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	390,564	-183	0.00
Vadeli Mevduat	571,145	-4,773	0.00
Eurobond	97,027,473	4,589,628	4.69