

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON

Aralık 2018

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) 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	:	222,538,196.99
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	177,227,119.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.255667
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.195975
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	4.99
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	24.58
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	24.58
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.41
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) TPP	:	0.00
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.55
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.04
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	85.155
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	:	1,450.27

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS0882347072	05/02/20	1,500,000.00	7,291,242.45	3.30
XS0847042024	24/10/22	5,500,000.00	24,618,312.23	11.14
XS0849728190	01/11/22	3,000,000.00	13,654,399.35	6.18
XS1003016018	10/11/23	200,000.00	928,187.69	0.42
XS1175854923	03/02/25	11,300,000.00	52,527,835.87	23.79
XS1376681067	09/03/26	6,000,000.00	30,875,356.74	13.97
XS1584113184	29/03/27	8,500,000.00	37,593,259.64	17.01
XS1551747733	01/11/27	1,800,000.00	7,954,317.02	3.60
XS1772360803	27/04/28	1,000,000.00	4,537,056.19	2.05
XS1623796072	29/06/28	9,600,000.00	39,318,721.71	17.79
TOPLAM:		48,400,000.00	219,298,688.89	99.25

MEVDUAT

Mevduat	02/01/19	314,719.63	1,662,136.81	0.75
TOPLAM:		314,719.63	1,662,136.81	0.75

PORTFÖY DEĞERİ:	48,714,719.63	220,960,825.70	100.00
-----------------	---------------	----------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	220,960,825.70	99.29 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1,776,671.24	0.80 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-199,299.95	-0.09 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	222,538,196.99	
		100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	0.00	0.0000 %
Ödenen Komisyonlar		

Fon Yönetim Ücreti	169,451.48	0.0761 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	348.82	0.0002 %
Kayda Alma Ücreti	11,129.71	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri	14,155.50	0.0064 %
İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	46.33	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	629.25	0.0003 %
Diğer Harcamalar	64.96	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	346.55	0.0002 %
TOPLAM:	196,172.60	0.0882 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA				
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
USD	6,515,522.000	1,519,069.08	16,053,215.000	3,774,807.96

DPB - Deniz Portföy Birinci Serbest Fon-31.12.2018 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	220,960,825.70
Fon Toplam Değeri	222,538,196.99
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	1.22

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	9,029,352.20			
RMD (%)	4.06			5.59
Beklenen Kayıp	11,963,237.03			
Beklenen Kayıp (%)	5.38			
Uç Değer Adedi	8			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyükölük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	1,662,137	104,225	0.05
Eurobond	219,298,689	8,948,828	4.02