

## DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON

Kasım 19

## I-FONU TANITICI BİLGİLER

|                           |   |                                              |
|---------------------------|---|----------------------------------------------|
| A-)Fonun Adı              | : | DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON |
| B-)Kurucunun Ünvanı       | : | DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.                  |
| C-)Yöneticinin Ünvanı     | : | DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.                  |
| D-)Fon Tutarı             | : | 50,000,000.00                                |
| E-)Fon Pay Sayısı         | : | 50,000,000.00                                |
| F-)Fon Toplam Değeri      | : | 40,013,828.83                                |
| G-)Tedavüldeki Pay Sayısı | : | 5,843,985.000                                |
| H-)Fonun Kuruluş Tarihi   | : | 10 Nisan 2019                                |
| I-)Fonun Süresi           | : | Süresizdir.                                  |

## II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

|                                      |   |          |
|--------------------------------------|---|----------|
| A-)Ay Sonu Pay Fiyatı                | : | 6.847011 |
| B-)Önceki Ay Pay Fiyatı              | : | 6.786774 |
| C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı      | : | 0.89     |
| D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı  | : | 0.67     |
| E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı     | : |          |
| F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi    | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 0.00     |
| b-)Hazine Bonosu                     | : | 0.00     |
| c-)Devlet Tahvili                    | : | 99.28    |
| 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                          | : | 0.72     |
| k-) Katılım Hesabı                   | : | 0.00     |
| l-)Diğer                             | : | 0.00     |
| G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı      | : | 9.428    |
| H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 0.00     |
| b-)Hazine Bonosu                     | : | 0.00     |
| c-)Devlet Tahvili                    | : | 0.02     |
| d-)Opsiyon                           | : | 0.00     |
| e-)Varant                            | : | 0.00     |
| f-)Diğer                             | : | 0.00     |
| I-)Portföyün Ortalama Vadesi         | : | 0.00     |

## III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

## BORÇLANMA SENETLERİ

|              |          |              |               |       |
|--------------|----------|--------------|---------------|-------|
| Eurobond     |          |              |               |       |
| XS1909184753 | 16/02/26 | 5,563,000.00 | 38,989,802.98 | 95.07 |
| XS1909184753 | 16/02/26 | 137,000.00   | 960,390.70    | 2.34  |
| TOPLAM:      |          | 5,700,000.00 | 39,950,193.68 | 97.41 |

## MEVDUAT

|         |          |            |              |      |
|---------|----------|------------|--------------|------|
| Mevduat | 02/12/19 | 166,664.39 | 1,052,906.58 | 2.57 |
| Mevduat | 02/12/19 | 6,000.00   | 6,005.97     | 0.02 |
| TOPLAM: |          | 172,664.39 | 1,058,912.55 | 2.59 |

|                 |              |               |        |
|-----------------|--------------|---------------|--------|
| PORTFÖY DEĞERİ: | 5,872,664.39 | 41,009,106.23 | 100.00 |
|-----------------|--------------|---------------|--------|

## IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

| AÇIKLAMA | TUTAR | ORAN% |
|----------|-------|-------|
|----------|-------|-------|

|                       |               |          |
|-----------------------|---------------|----------|
| A-)FON PORTFÖY DEĞERİ | 41,009,106.23 | 102.49 % |
| B-)HAZIR DEĞERLER     | 1,457.39      | 0.00 %   |
| C-)ALACAKLAR          | 0.00          | 0.00 %   |
| D-)DİĞER VARLIKLAR    | 0.00          | 0.00 %   |
| E-)BORÇLAR            | -996,734.79   | -2.49 %  |
| F-)İHTİYAT            | 0.00          | 0.00 %   |
| G-)VERGİ              | 0.00          | 0.00 %   |
| FON TOPLAM DEĞERİ     | 40,013,828.83 | 100,00 % |

## V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| AÇIKLAMA                                      | TUTAR     | ORAN%    |
|-----------------------------------------------|-----------|----------|
| Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda   | 0.00      | 0.0000 % |
| Ödenen Komisyonlar                            |           |          |
| Fon Yönetim Ücreti                            | 27,564.17 | 0.0689 % |
| Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve    | 371.38    | 0.0009 % |
| İlan Giderleri                                |           |          |
| Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri | 2,995.92  | 0.0075 % |
| İçin Ödenen Ücretler                          |           |          |
| Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri        | 125.38    | 0.0003 % |
| Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen         | 882.77    | 0.0022 % |
| Denetim Ücreti                                |           |          |
| Diğer Harcamalar                              | -0.06     | 0.0000 % |
| BİST KYD Ücreti                               | 328.77    | 0.0008 % |
| TOPLAM:                                       | 32,268.33 | 0.0806 % |

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

| Sirketin Unvanı | 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 |
|-------------|--------------|-------------|---------------|--------------|
| EUR         | 167,888.000  | 180,732.44  | 2,321,991.000 | 2,520,668.32 |

#### DSD - Deniz Portföy İkinci Serbest (Döviz) Fon-29.11.2019 Risk Bildirim Tablosu

|                               |               |
|-------------------------------|---------------|
| Fon Portföy Değeri            | 41,009,106.23 |
| Fon Toplam Değeri             | 40,013,828.83 |
| Risk Değeri                   | 5             |
| Fon Portföyü Standart Sapması | 0.51          |

#### Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| Açık Pozisyon Tutarı |              |
| Kaldıraç Oranı       | Limit : 5.00 |

#### RMD Özeti

|                    | Fon        |  |  | Limit |
|--------------------|------------|--|--|-------|
| RMD                | 486,389.63 |  |  |       |
| RMD (%)            | 1.22       |  |  | 5.59  |
| Beklenen Kayıp     | 558,742.17 |  |  |       |
| Beklenen Kayıp (%) | 1.40       |  |  |       |
| Uç Değer Adedi     | 0          |  |  |       |

#### RMD Kırılımı

| Piyasa         | Büyüklik   | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|----------------|------------|-----------|---------------|
| Vadeli Mevduat | 1,058,913  | 10,064    | 0.03          |
| Eurobond       | 39,950,194 | 472,166   | 1.18          |