

DBP-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON**Ocak-2020****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DBP-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN 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	:	5.000.000.000,00
F-)Fon Toplam Değeri	:	105.031.362,94
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	2.638.069.300,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	31 Temmuz 2008
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	0,039814
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	0,039320
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1,26
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1,26
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	21,96
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	4,11
b-)Hazine Bonosu	:	3,00
c-)Devlet Tahvili	:	3,12
d-) Özel Sektör Tahvili	:	25,45
e-)Devlet Tahvili Repo	:	56,43
f-) TPP	:	0,28
g-) Opsiyon	:	0,00
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	0,15
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	7,46
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	40,768
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,01
b-)Hazine Bonosu	:	0,12
c-)Devlet Tahvili	:	0,16
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	44,03

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
AEFES		3.400,00	84.252,00	0,08

DBP-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON
Ocak-2020

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
AKBNK		48.200,00	398.132,00	0,38
ARCLK		3.550,00	74.195,00	0,07
ASELS		4.700,00	110.262,00	0,11
BIMAS		800,00	39.024,00	0,04
CCOLA		1.330,00	61.579,00	0,06
EKGYO		62.000,00	103.540,00	0,10
ENKAI		4.000,00	28.200,00	0,03
EREGL		15.000,00	139.950,00	0,13
FROTO		600,00	45.000,00	0,04
GARAN		20.000,00	238.000,00	0,23
HALKB		1.000,00	6.920,00	0,01
ISCTR		37.000,00	268.250,00	0,25
ISGYO		1,00	1,88	0,00
KCHOL		1.500,00	29.310,00	0,03
KRDMD		50.000,00	141.000,00	0,13
MGROS		1.000,00	25.200,00	0,02
PETKM		53.480,00	215.524,40	0,21
PGSUS		2.950,00	202.370,00	0,19
SAHOL		2.500,00	24.375,00	0,02
SISE		1.750,00	9.730,00	0,01
SODA		13.500,00	89.775,00	0,08
TATGD		9.300,00	67.890,00	0,07
TAVHL		500,00	13.620,00	0,01
TCELL		3.745,00	52.804,50	0,05
THYAO		13.000,00	177.840,00	0,17
TKFEN		1.000,00	19.250,00	0,02
TOASO		6.400,00	168.960,00	0,16
TRKCM		10.000,00	40.300,00	0,04
TSKB		30.000,00	41.100,00	0,04
TTKOM		26.000,00	201.500,00	0,19
TUPRS		425,00	47.855,00	0,04
VAKBN		26.500,00	174.900,00	0,17
YATAS		2.000,00	16.800,00	0,02
YKBNK		98.715,00	293.183,55	0,28
TOPLAM:		555.846,00	3.650.593,33	3,48

BORÇLANMA SENETLERİ

Devlet Tahvili				
TRT050220T17	05/02/20	5.000.000,00	5.181.858,74	4,93
TRT010420T19	01/04/20	30.000,00	76.361,14	0,07
TRT130520T14	13/05/20	200.000,00	194.778,52	0,19
TRT140421T13	14/04/21	3.000.000,00	2.673.468,96	2,54
TRT220921T18	22/09/21	100.000,00	102.313,14	0,10

DBP-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON
Ocak-2020

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
TRT120122T17	12/01/22	50.000,00	49.855,88	0,05
TRT180123T10	18/01/23	200.000,00	213.151,19	0,20
TRT120325T12	12/03/25	800.000,00	767.540,28	0,73
Eurobond				
XS1188073081	11/02/21	500.000,00	3.018.806,01	2,87
Özel Sektör				
TRFYKBK22055	21/02/20	1.000.000,00	994.979,80	0,95
TRFOYMD22026	26/02/20	500.000,00	496.659,59	0,47
TRFTHAL22010	26/02/20	1.000.000,00	1.002.794,56	0,95
TRFAKBK32021	03/03/20	500.000,00	495.939,29	0,47
TRFVKFB32019	03/03/20	370.000,00	377.003,41	0,36
TRFTISB32010	05/03/20	100.000,00	101.896,15	0,10
TRFYKBK32013	06/03/20	600.000,00	601.408,50	0,57
TRFYAKF32023	10/03/20	1.000.000,00	990.137,47	0,94
TRFNURL32019	11/03/20	1.000.000,00	989.036,87	0,94
TRFFNBK32016	13/03/20	100.000,00	101.837,65	0,10
TRFFNYM32014	17/03/20	1.500.000,00	1.482.563,23	1,41
TRFAKBK32013	26/03/20	1.000.000,00	1.012.219,35	0,96
TRFGRAN42010	20/04/20	1.200.000,00	1.207.022,10	1,15
TRFHLLFK52015	13/05/20	1.070.000,00	1.041.514,84	0,99
TRFISGY52017	29/05/20	550.000,00	530.941,31	0,50
TRFEGYO62014	03/06/20	3.000.000,00	2.898.258,78	2,76
TRFFINF62018	16/06/20	1.000.000,00	962.081,97	0,91
TRFAKYB62011	19/06/20	500.000,00	500.815,01	0,48
TRFISFN72010	10/07/20	770.000,00	736.161,33	0,70
TRFTCZB82013	27/08/20	440.000,00	451.521,85	0,43
TRSARCL22117	12/02/21	830.000,00	863.407,72	0,82
TRSOPAS22111	18/02/21	100.000,00	102.319,36	0,10
TRSBMKS12214	11/01/22	400.000,00	52.581,24	0,05
TOPLAM:		28.410.000,00	30.271.235,24	28,79

TÜREV İŞLEMLER

Özel Sektör				
TRSBMKS12214	11/01/22	400.000,00	-52.581,24	-0,05
TOPLAM:		400.000,00	-52.581,24	-0,05

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRSBMKS12230	11/01/22	140.000,00	149.512,69	0,14
TOPLAM:		140.000,00	149.512,69	0,14

TÜREV İŞLEMLER

DBP-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON
Ocak-2020

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
Özel Sektör				
TRSBMKS12230	11/01/22	140.000,00	-149.512,69	-0,14
	TOPLAM:	140.000,00	-149.512,69	-0,14
BORÇLANMA SENETLERİ				
Bono				
TRPAK5F42018	24/04/20	550.000,00	524.751,77	0,50
TRPAKT262012	16/06/20	2.000.000,00	1.924.157,21	1,83
	TOPLAM:	2.550.000,00	2.448.908,98	2,33
T.REPO				
TRT050624T19	03/02/20	2.005.320,00	2.001.686,58	1,90
TRT050624T19	03/02/20	1.002.690,00	1.000.872,05	0,95
TRT060121T16	03/02/20	7.025.190,00	16.514.104,11	15,70
TRT080323T10	03/02/20	19.471.240,00	18.015.179,18	17,10
TRT111120T18	03/02/20	10.629.475,00	11.009.583,56	10,47
TRT120325T12	03/02/20	9.734.630,00	9.007.841,10	8,56
TRT280628T18	03/02/20	2.852.835,00	3.502.991,78	3,33
	TOPLAM:	52.721.380,00	61.052.258,36	58,01
MEVDUAT				
Mevduat	03/02/20	3.768,75	22.510,97	0,02
Mevduat	28/02/20	400.000,00	400.323,50	0,38
	TOPLAM:	403.768,75	422.834,47	0,40
DİĞER				
DBH-DENİZ PORTFÖY EUROBOND (DÖVİZ) BORÇLANMA ARAÇ DDC - DÖRDÜNCÜ SERBEST FON		20.000.000,00	627.180,00	0,60
DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST (DÖVİZ) FON		90.401,00	99.999,15	0,10
		1.261.211,00	2.379.371,80	2,26
	TOPLAM:	21.351.612,00	3.106.550,95	2,96
TÜREV				
USD/TRY 6,0174 43367	28/02/20	-510.000,00	4.652,22	0,00
	TOPLAM:	-510.000,00	4.652,22	0,00
BORÇLANMA SENETLERİ				
Devlet Tahvili				
TRD140721T18	14/07/21	10.000,00	10.065,71	0,01
Özel Sektör				
TRDABVK22016	07/02/20	500.000,00	515.548,56	0,49
TRDHVKA32020	03/03/20	200.000,00	208.815,92	0,20

DBP-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON
Ocak-2020

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
TRDABVK32023	13/03/20	3.000.000,00	3.052.673,42	2,90
TRDABVK72011	03/07/20	500.000,00	502.947,29	0,48
	TOPLAM:	4.210.000,00	4.290.050,90	4,08
PORTFÖY DEĞERİ:		110.372.606,75	105.194.503,21	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	105.194.503,21	100,16 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5.254,52	0,01 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-168.394,79	-0,16 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	105.031.362,94	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	8.256,43	0,0079 %
Fon Yönetim Ücreti	142.665,35	0,1358 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	279,36	0,0003 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	7.106,39	0,0068 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	117,60	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	490,60	0,0005 %
Diğer Harcamalar	367,32	0,0003 %
BİST KYD Ücreti	907,41	0,0009 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	34,55	0,0000 %
TOPLAM:	160.225,01	0,1526 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ 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
TL	360.956.400,616	14.314.566,25	1.468.738.400,000	58.242.584,16