

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**O-2020****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	:	2,000,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	749,652,656.83
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	395,509,086.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.895412
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.775022
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	6.78
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6.78
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	46.78
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.29
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.08
f-) TPP	:	0.02
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.57
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.04
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	16.975
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.04
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1,280.49

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS0849728190	01/11/22	1,000,000.00	6,220,480.68	0.75
XS1867595750	15/01/24	17,175,000.00	122,987,373.43	14.85
XS1376681067	09/03/26	400,000.00	2,558,158.04	0.31
XS1584113184	29/03/27	17,300,000.00	108,230,928.08	13.07
XS1551747733	01/11/27	11,660,000.00	72,972,359.39	8.81
XS1772360803	27/04/28	747,000.00	4,563,541.81	0.55

XS1623796072	29/06/28	16,162,000.00	98,209,148.97	11.86
XS2106022754	22/01/30	28,400,000.00	173,315,247.60	20.94
US900123AT75	14/02/34	1,000,000.00	7,506,332.38	0.91
US900123AY60	17/03/36	9,000,000.00	61,126,145.42	7.38
US900123BB58	05/03/38	2,500,000.00	17,647,366.92	2.13
US900123CB40	16/04/43	2,000,000.00	10,862,402.12	1.31
US900123CG37	17/02/45	3,000,000.00	19,758,177.50	2.39
US900123CM05	13/05/47	7,000,000.00	40,944,601.68	4.95
XS1867595750	15/01/24	2,000,000.00	14,335,354.80	1.73
XS1551747733	01/11/27	200,000.00	1,252,237.88	0.15
XS2106022754	22/01/30	4,600,000.00	28,084,851.04	3.39
XS2106022754	22/01/30	3,000,000.00	18,316,207.20	2.21
US900123CG37	17/02/45	2,000,000.00	13,176,650.60	1.59
US900123CG37	17/02/45	1,000,000.00	6,587,226.20	0.80
XS1772360803	27/04/28	-747,000.00	-4,564,433.62	-0.55
TOPLAM:		129,397,000.00	824,090,358.12	99.53

T.REPO

TRT070727T13	03/02/20	364,415.00	500,425.34	0.06
TOPLAM:		364,415.00	500,425.34	0.06

MEVDUAT

Mevduat	03/02/20	536,468.44	3,204,360.88	0.39
TOPLAM:		536,468.44	3,204,360.88	0.39

TPP

TPP	03/02/20	97,082.52	97,082.52	0.01
TPP	03/02/20	48,040.64	48,040.64	0.01
TOPLAM:		145,123.16	145,123.16	0.02

PORTFÖY DEĞERİ: 130,443,006.60 827,940,267.50 100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	827,940,267.50	110.44 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,245.12	0.00 %
C-)ALACAKLAR	4,549,933.61	0.61 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-82,840,789.40	-11.05 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	749,652,656.83	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden	154.78	0.0000 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	549,423.49	0.0733 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	279.36	0.0000 %
Tescil ve İlan Giderleri		
Portföydeki Varlıkların Saklanması	43,188.22	0.0058 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	74.65	0.0000 %

Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	540.41	0.0001 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	0.30	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	558.72	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	11.75	0.0000 %
TOPLAM:	594,231.68	0.0793 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE 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
USD	47,724,069.000	14,733,111.74	148,052,809.000	45,857,897.26

DPB - Deniz Portföy Birinci Serbest (Döviz) Fon-31.01.2020 Risk Bildirim Tablosu				
Fon Portföy Değeri	827.940.267,50			
Fon Toplam Değeri	749.652.656,83			
Risk Değeri	5			
Fon Portföyü Standart Sapması	0,50			
Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi				
Açık Pozisyon Tutarı				
Kaldıraç Oranı			Limit : 5.00	
RMD Özeti				
	Fon			Limit
RMD	15.518.253,86			
RMD (%)	2,07			5,59
Beklenen Kayıp	32.400.249,62			
Beklenen Kayıp (%)	4,32			
Uç Değer Adedi	1			
RMD Kırılımı				
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)	