

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**Ş-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	:	889,370,280.17
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	485,822,212.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.830650
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.895412
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-3.42
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	3.13
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	31.85
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.83
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.01
f-) TPP	:	0.01
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.15
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	23.507
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	:	1,276.77

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS0849728190	01/11/22	1,000,000.00	6,275,731.58	0.67
XS1867595750	15/01/24	20,656,000.00	148,352,898.24	15.82
XS1584113184	29/03/27	17,300,000.00	109,256,858.73	11.65
XS1551747733	01/11/27	11,860,000.00	74,903,251.14	7.98
XS1623796072	29/06/28	16,162,000.00	95,934,931.87	10.23
XS2106022754	22/01/30	43,400,000.00	259,022,236.22	27.61

US900123CY43	13/03/30	7,000,000.00	40,003,219.98	4.27
US900123BB58	05/03/38	2,500,000.00	16,730,724.45	1.78
US900123CB40	16/04/43	2,000,000.00	10,317,351.22	1.10
US900123CG37	17/02/45	14,000,000.00	82,958,446.17	8.84
US900123CM05	13/05/47	9,000,000.00	49,313,535.66	5.26
US900123AY60	17/03/36	14,000,000.00	89,569,800.60	9.55
XS0849728190	01/11/22	-1,000,000.00	-6,275,731.60	-0.67
US900123CY43	13/03/30	-7,000,000.00	-40,014,025.10	-4.27
TOPLAM:		150,878,000.00	936,349,229.16	99.82

MEVDUAT

Mevduat	02/03/20	264,273.90	1,645,471.00	0.18
TOPLAM:		264,273.90	1,645,471.00	0.18

TPP

TPP	02/03/20	46,041.40	46,041.40	0.00
TOPLAM:		46,041.40	46,041.40	0.00

PORTFÖY DEĞERİ:		151,188,315.30	938,040,741.56	100.00
-----------------	--	----------------	----------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	938,040,741.56	105.47 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,284.53	0.00 %
C-)ALACAKLAR	46,184,245.07	5.19 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-94,857,990.99	-10.67 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	889,370,280.17	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	37.42	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	683,137.36	0.0768 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	244.44	0.0000 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	56,136.27	0.0063 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	232.17	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	422.52	0.0000 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	209.65	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	488.88	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	5.80	0.0000 %
TOPLAM:	740,914.51	0.0832 %

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
-------------	--------------	-------------	---------------	--------------

USD

44,878,148.000

14,032,083.76

135,191,274.000

42,398,483.83



FON RİSK RAPORU

28.02.2020

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	938,040,741.56
Fon Toplam Değeri	889,370,280.17
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.56

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

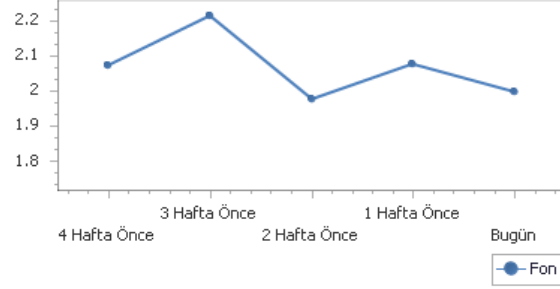
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	17,733,342.59			
RMD (%)	1.99			5.59
Beklenen Kayıp	35,381,288.83			
Beklenen Kayıp (%)	3.98			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

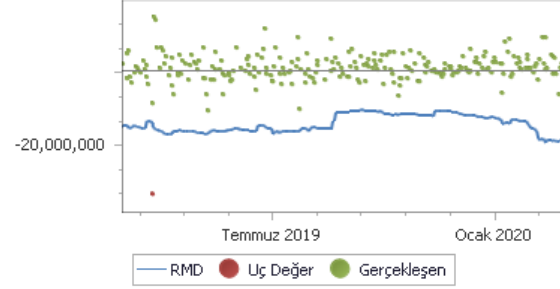
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	1,645,471	16,011	0.00
Takasbank Para Piyasası	46,041	-96	0.00
Eurobond	936,349,229	17,699,434	1.99

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
----------------------------	--------------------	-----------	---------------

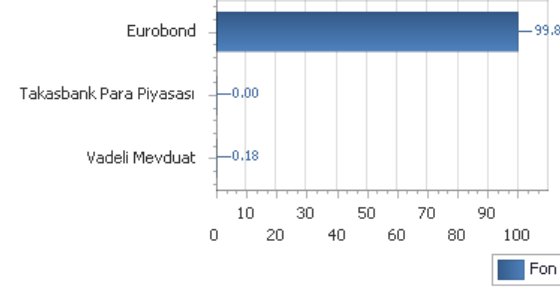
Fon RMD Trendi



Geriyeye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

