

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**M-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	:	746,410,418.29
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	442,877,867.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.685364
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.830650
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-7.94
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	-5.05
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	28.29
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.92
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) TPP	:	0.01
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.07
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	23.268
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	:	916.65

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	20,656,000.00	138,027,626.99	18.01
XS1584113184	29/03/27	17,300,000.00	100,918,755.05	13.17
XS1551747733	01/11/27	11,860,000.00	73,493,425.36	9.59
XS1623796072	29/06/28	14,674,000.00	82,274,719.15	10.74
XS2106022754	22/01/30	41,651,000.00	222,499,231.44	29.04
US900123BB58	05/03/38	2,500,000.00	15,137,773.68	1.98

US900123CB40	16/04/43	2,000,000.00	9,466,230.96	1.24
US900123CG37	17/02/45	10,100,000.00	55,441,117.89	7.23
US900123CM05	13/05/47	9,000,000.00	45,158,849.13	5.89
US900123CG37	17/02/45	3,900,000.00	21,407,956.44	2.79
US900123CM05	13/05/47	-200,000.00	-1,003,529.98	-0.13
US900123CM05	13/05/47	-300,000.00	-1,505,294.97	-0.20
TOPLAM:		133,141,000.00	761,316,861.14	99.35

MEVDUAT

Mevduat	01/04/20	744,601.61	4,891,801.55	0.64
TOPLAM:		744,601.61	4,891,801.55	0.64

TPP

TPP	01/04/20	60,015.04	60,015.04	0.01
TOPLAM:		60,015.04	60,015.04	0.01

PORTFÖY DEĞERİ:		133,945,616.65	766,268,677.73	100.00
-----------------	--	----------------	----------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	766,268,677.73	102.66 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,996.95	0.00 %
C-)ALACAKLAR	2,527,197.34	0.34 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-22,389,453.73	-3.00 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	746,410,418.29	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar Fon Yönetim Ücreti	30.89	0.0000 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri Kayda Alma Ücreti	664,463.38	0.0890 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	263.16	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti BİST KYD Ücreti	37,320.52	0.0050 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	53,954.53	0.0072 %
TOPLAM:	77.31	0.0000 %
	452.70	0.0001 %
	523.80	0.0001 %
	5.44	0.0000 %
TOPLAM:	757,091.73	0.1014 %

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	64,837,506.000	17,872,242.98	21,893,161.000	6,144,485.22

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	766,268,677.73
Fon Toplam Değeri	746,410,418.29
Risk Değeri	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.97

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

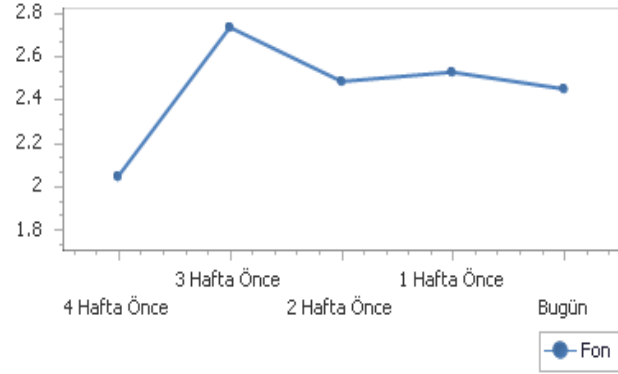
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	18,272,652.86			
RMD (%)	2.45			5.59
Beklenen Kayıp	18,919,930.70			
Beklenen Kayıp (%)	2.53			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

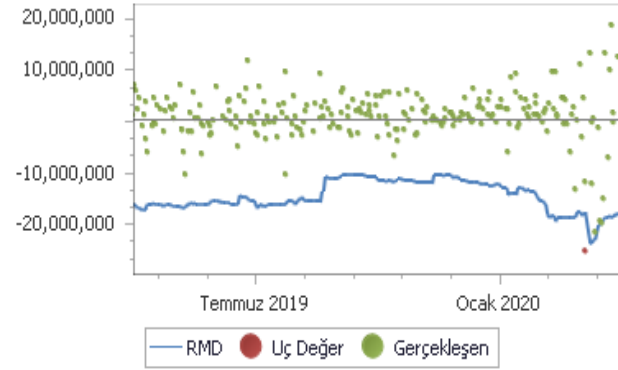
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	4,891,802	1,213	0.00
Takasbank Para Piyasası	60,015	-16	0.00
Eurobond	761,316,861	18,182,010	2.44

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

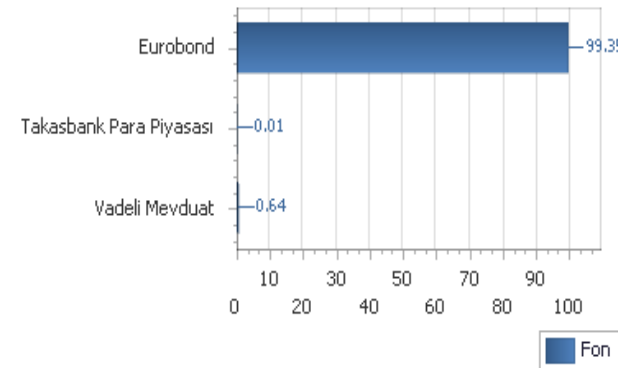
Fon RMD Trendi



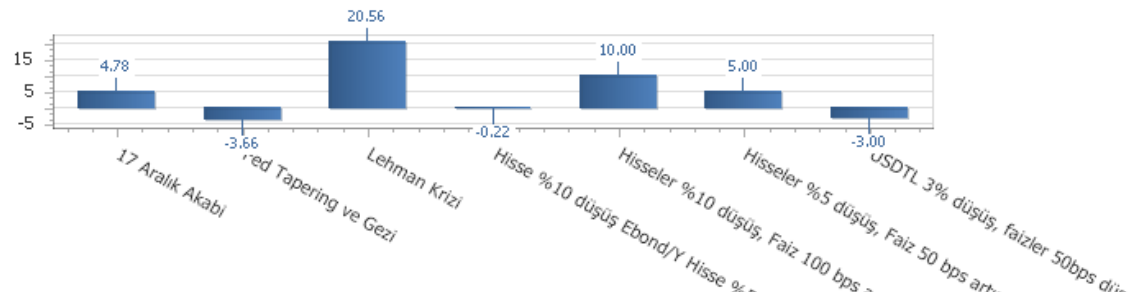
Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi



alış, hisse 5% artış
ğer kaybı

TL %50 değer kaybı

... TL %5
... TL %10 değer kaybı
... MK +150 bps Fx %

SGMK +150 bps Fx %5 artış

