

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**T-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	:	939,072,959.30
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	467,943,298.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	2.006809
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.978176
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.45
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	13.06
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	39.71
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.76
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.01
f-) TPP	:	0.00
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.13
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.10
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	24.334
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	906.37

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	21,041,000.00	159,172,951.53	16.79
XS2100270508	23/01/25	2,000,000.00	13,258,082.62	1.40
XS2112797290	05/02/25	5,010,000.00	33,018,006.86	3.48
XS1584113184	29/03/27	15,720,000.00	106,935,947.65	11.28
XS1551747733	01/11/27	16,708,000.00	110,605,837.78	11.67
XS1623796072	29/06/28	11,624,000.00	75,438,411.89	7.96
XS2106022754	22/01/30	40,021,000.00	264,012,940.87	27.84
US900123BB58	05/03/38	1,500,000.00	10,565,387.24	1.11

US900123CG37	17/02/45	17,000,000.00	108,143,296.48	11.40
US900123CM05	13/05/47	11,820,000.00	66,517,809.26	7.02
	TOPLAM:	142,444,000.00	947,668,672.18	99.95

MEVDUAT

Mevduat	04/08/20	71,955.05	499,173.37	0.05
Mevduat	04/08/20	5,000.00	5,004.71	0.00
	TOPLAM:	76,955.05	504,178.08	0.05
PORTFÖY DEĞERİ:		142,520,955.05	948,172,850.26	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	948,172,850.26	100.97 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1,466.17	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-979,599.57	-0.10 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-8,121,757.56	-0.86 %
FON TOPLAM DEĞERİ	939,072,959.30	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden	24.79	0.0000 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	899,846.42	0.0958 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	296.82	0.0000 %
Tescil ve İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	15,243.26	0.0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	70,814.46	0.0075 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	2,449,745.24	0.2609 %
Ödenen Denetim Kuruluşlarına	1,156.97	0.0001 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	-0.07	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	593.64	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	2.40	0.0000 %
TOPLAM:	3,437,723.93	0.3660 %

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	46,227,018.000	13,429,182.23	14,369,900.000	4,171,090.42



FON RİSK RAPORU

30.07.2020

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri	Fon RMD Trendi
Fon Portföy Değeri	948,172,850.26
Fon Toplam Değeri	939,072,959.30
Risk Değeri	7
Fon Portföyü Standart Sapması	0.60



Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

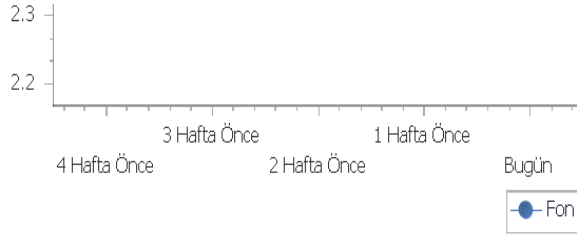
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelı	Limit
RMD	23,559,347.23			
RMD (%)	2.51			5.59
Beklenen Kayıp	23,708,492.37			
Beklenen Kayıp (%)	2.52			
Uç Değer Adedi	1			

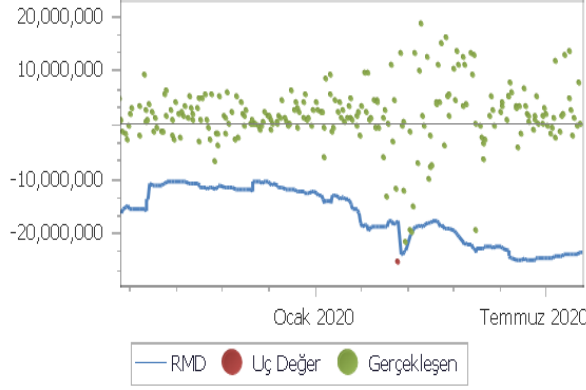
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	504,178	-2,275	0.00
Eurobond	947,668,672	23,550,717	2.51

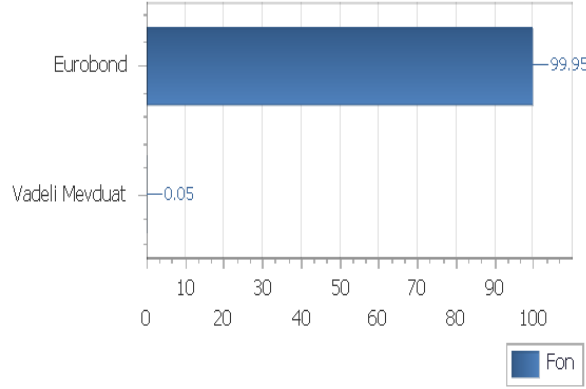
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyükliğı	Artık RMD	Artık RMD (%)
---------------------------	--------------------	-----------	---------------



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

