

DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON**E-2020****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) 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	:	50,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	106,595,479.45
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	10,831,942.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	10 Nisan 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	9.840847
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	9.152681
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	7.52
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	33.96
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	45.00
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	98.77
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) TPP	:	0.00
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	1.23
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	21.431
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	:	0.00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1843443356	31/03/25	2,320,000.00	22,803,018.06	20.59
XS1909184753	16/02/26	7,290,000.00	73,451,822.88	66.33
	TOPLAM:	9,610,000.00	96,254,840.94	86.92
MEVDUAT				
Mevduat	02/11/20	1,491,688.18	14,467,197.07	13.07
Mevduat	02/11/20	8,000.00	8,007.70	0.01
	TOPLAM:	1,499,688.18	14,475,204.77	13.08

PORTFÖY DEĞERİ: 11,109,688.18 110,730,045.71 100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	110,730,045.71	103.88 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,763.45	0.01 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-104,815.77	-0.10 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-4,035,513.94	-3.79 %
FON TOPLAM DEĞERİ	106,595,479.45	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0.00	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	89,358.12	0.0838 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	279.36	0.0003 %
Kayda Alma Ücreti	1,764.09	0.0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	9,149.30	0.0086 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	1,299,828.73	1.2194 %
Ödemeleri	750.40	0.0007 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	0.01	0.0000 %
Diğer Harcamalar	0.01	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	351.68	0.0003 %
TOPLAM:	1,401,481.69	1.3148 %

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
EUR	38,131.000	38,776.98	293,995.000	299,999.26



FON RİSK RAPORU

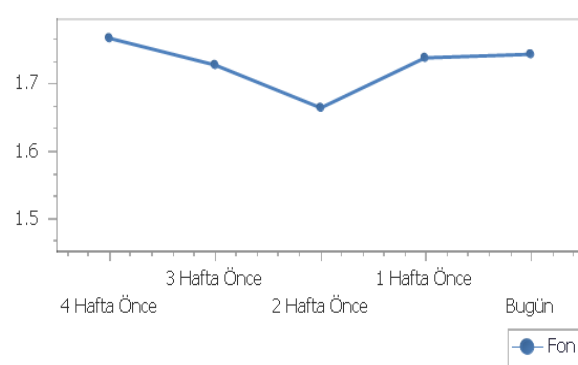
30.10.2020

DSD - Deniz Portföy İkinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	110,730,045.71
Fon Toplam Değeri	106,595,479.45
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.72

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1,859,363.04			
RMD (%)	1.74			5.50

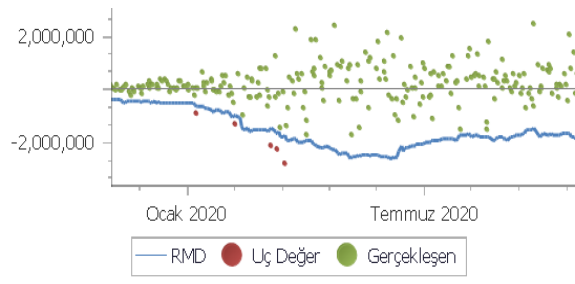
Geriye Dönük Test



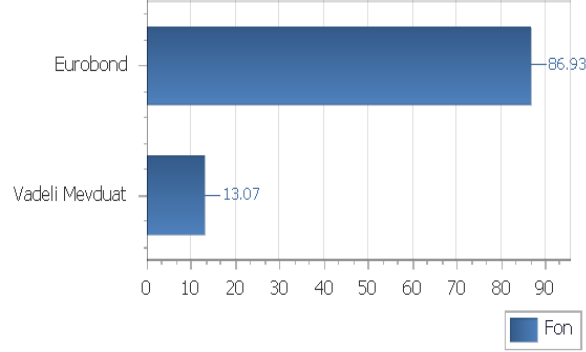
RMD (%)	1.74			5.59
Beklenen Kayıp	2,135,951.25			
Beklenen Kayıp (%)	2.00			
Uç Değer Adedi	5			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	14,475,205	203,373	0.19
Eurobond	96,254,841	1,614,075	1.51
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

