

DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON**E-2020****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	200,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	144,218,159.65
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	17,016,295.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	18 Mayıs 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	8.475297
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	7.969990
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	6.34
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6.69
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.58
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	:	0.42
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	8.902
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	:	203.76

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1188073081	11/02/21	1,000,000.00	8,354,304.28	5.58
XS0847042024	24/10/22	440,000.00	3,556,741.49	2.38
XS0849728190	01/11/22	870,000.00	7,224,287.79	4.82
XS0861979440	06/12/22	1,300,000.00	10,749,470.96	7.18
XS1003016018	11/12/23	200,000.00	1,722,367.53	1.15
US900123CR91	25/12/23	8,500,000.00	74,168,613.57	49.53
XS1970705528	28/03/24	4,120,000.00	34,705,544.61	23.17
US900123CW86	14/11/24	1,000,000.00	8,226,884.59	5.49

TOPLAM: 17,430,000.00 148,708,214.82 99.30

MEVDUAT

Mevduat	02/11/20	126,291.09	1,049,268.83	0.70
TOPLAM:		126,291.09	1,049,268.83	0.70
PORTFÖY DEĞERİ:		17,556,291.09	149,757,483.65	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	149,757,483.65	103.84 %
B-)HAZIR DEĞERLER	9,038.01	0.01 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-955,652.59	-0.66 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-4,592,709.42	-3.18 %
FON TOPLAM DEĞERİ	144,218,159.65	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0.00	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	127,134.01	0.0882 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	539.20	0.0004 %
Kayda Alma Ücreti	2,517.57	0.0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	12,187.58	0.0085 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1,549,297.50	1.0743 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	1,318.72	0.0009 %
Ödenen Denetim Ücreti	-0.08	0.0000 %
Diğer Harcamalar	494.00	0.0003 %
BİST KYD Ücreti	1,693,488.50	1.1743 %
TOPLAM:		

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	1,192,173.000	1,227,731.66	97,037.000	99,998.57



FON RİSK RAPORU

30.10.2020

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	153,071,932.18
Fon Toplam Değeri	142,087,320.45
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.69

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

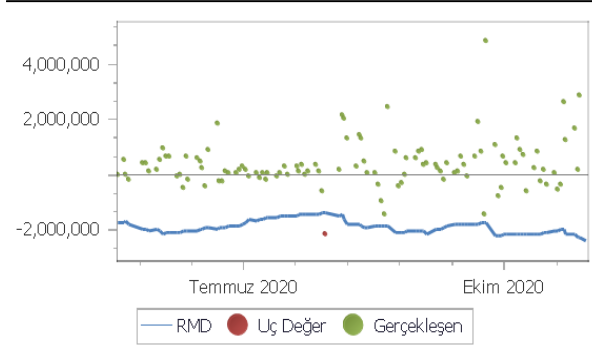
RMD Özeti

	Fon	Kıtas	Görelî	Lîmit
RMD	2,396,042.66			
RMD (%)	1.69			5.59
Beklenen Kayıp	2,752,464.27			
Beklenen Kayıp (%)	1.94			
Uç Değer Adedi	1			

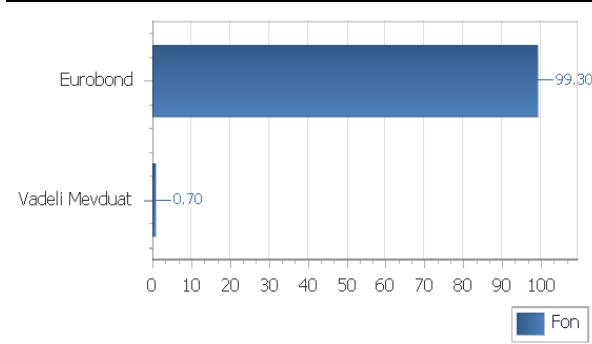
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	1,049,269	17,099	0.01
Eurobond	148,708,215	2,377,189	1.67
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyükliğı	Artık RMD	Artık RMD (%)

Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

