

DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON**K-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	:	86,199,479.13
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	10,359,415.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	18 Mayıs 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	8.320883
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	8.475297
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-1.82
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	-2.44
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	96.84
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	2.15
f-) TPP	:	0.00
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	1.01
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	7.662
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.03
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	373.18

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1188073081	11/02/21	1,000,000.00	7,891,654.04	9.84
XS0849728190	01/11/22	870,000.00	6,787,652.63	8.47
XS0861979440	06/12/22	1,300,000.00	10,374,439.10	12.94
XS1003016018	11/12/23	200,000.00	1,681,840.44	2.10
US900123CR91	25/12/23	2,000,000.00	17,209,111.06	21.46
XS1970705528	28/03/24	4,120,000.00	34,403,428.62	42.91
US900123CW86	14/11/24	1,000,000.00	8,001,418.31	9.98
US900123CR91	25/12/23	-1,000,000.00	-8,604,555.50	-10.73

US900123CR91	25/12/23	-1,000,000.00	-8,604,555.50	-10.73
	TOPLAM:	8,490,000.00	69,140,433.20	86.24

T.REPO

TRT070727T13	01/12/20	3,112,425.00	5,002,164.38	6.24
	TOPLAM:	3,112,425.00	5,002,164.38	6.24

MEVDUAT

Mevduat	01/12/20	770,308.92	6,000,123.03	7.48
Mevduat	01/12/20	35,000.00	35,013.39	0.04
	TOPLAM:	805,308.92	6,035,136.42	7.52
PORTFÖY DEĞERİ:		12,407,733.92	80,177,734.00	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	80,177,734.00	93.01 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,875.44	0.01 %
C-)ALACAKLAR	17,198,077.52	19.95 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-6,845,940.26	-7.94 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-4,336,267.57	-5.03 %
FON TOPLAM DEĞERİ	86,199,479.13	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	496.13	0.0006 %
Fon Yönetim Ücreti	101,330.74	0.1176 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	488.65	0.0006 %
Kayda Alma Ücreti	2,044.46	0.0024 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	10,780.21	0.0125 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	-256,283.36	-0.2973 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	1,253.08	0.0015 %
Ödenen Denetim Ücreti		
BİST KYD Ücreti	380.00	0.0004 %
TOPLAM:	-139,510.09	-0.1617 %

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	8,007,367.000	8,494,519.83	1,350,487.000	1,380,975.93



FON RİSK RAPORU

30.11.2020

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	80,177,734.00
Fon Toplam Değeri	86,199,479.13
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.91

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

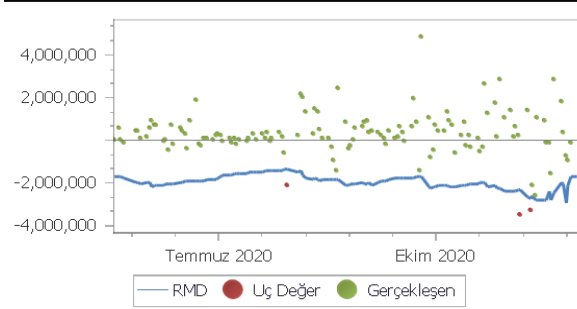
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1,696,622.60			
RMD (%)	1.97			5.59
Beklenen Kayıp	1,949,002.48			
Beklenen Kayıp (%)	2.26			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

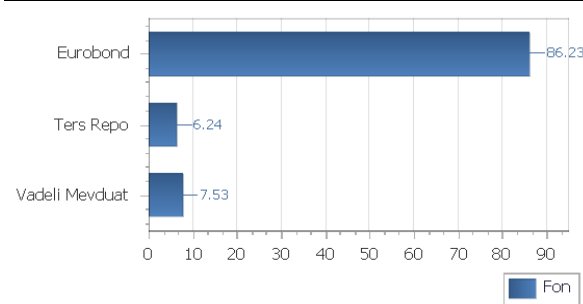
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	6,035,136	146,080	0.17
Ters Repo	5,002,164	1,039	0.00
Eurobond	69,140,433	1,542,625	1.79

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

Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

