

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**K-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	:	914,476,364.35
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	386,708,681.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	2.364768
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	2.334034
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.32
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	33.22
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	40.71
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	98.95
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.88
f-) TPP	:	0.02
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.15
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	19.939
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.01
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	792.25

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	18,661,000.00	168,714,738.32	18.50
XS1584113184	29/03/27	15,720,000.00	119,919,408.76	13.15
XS1551747733	01/11/27	13,258,000.00	103,507,958.28	11.35
XS1623796072	29/06/28	8,854,000.00	68,802,050.51	7.54
XS2106022754	22/01/30	35,521,000.00	279,297,088.73	30.65
US900123BB58	05/03/38	1,000,000.00	8,526,173.01	0.94
US900123CG37	17/02/45	13,600,000.00	107,941,786.42	11.84
US900123CM05	13/05/47	8,320,000.00	58,835,487.11	6.45

US900123DA57	15/01/31	1,000,000.00	7,810,737.10	0.86
XS1867595750	15/01/24	-600,000.00	-5,426,807.70	-0.60
XS1584113184	29/03/27	-260,000.00	-1,983,814.79	-0.22
XS2106022754	22/01/30	-2,000,000.00	-15,729,060.40	-1.73
XS2106022754	22/01/30	-3,000,000.00	-23,588,617.20	-2.59
TOPLAM:		110,074,000.00	876,627,128.15	96.14

T.REPO

TRT050527T17	01/12/20	15,069,585.00	14,506,276.71	1.59
TRT050527T17	01/12/20	3,637,490.00	3,501,515.07	0.38
TOPLAM:		18,707,075.00	18,007,791.78	1.97

MEVDUAT

Mevduat	01/12/20	2,159,230.78	16,818,772.30	1.84
TOPLAM:		2,159,230.78	16,818,772.30	1.84

TPP

TPP	01/12/20	444,194.63	444,194.63	0.05
TOPLAM:		444,194.63	444,194.63	0.05

PORTFÖY DEĞERİ:	131,384,500.41	911,897,886.86	100.00
-----------------	----------------	----------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	911,897,886.86	99.72 %
B-)HAZIR DEĞERLER	4,932.64	0.00 %
C-)ALACAKLAR	46,554,999.58	5.09 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-8,602,753.30	-0.94 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-35,378,701.43	-3.87 %
FON TOPLAM DEĞERİ	914,476,364.35	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar Fon Yönetim Ücreti	1,502.15	0.0002 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri Kayda Alma Ücreti	742,441.32	0.0812 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	253.17	0.0000 %
Ödenen Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti Diğer Harcamalar	14,777.15	0.0016 %
BİST KYD Ücreti	61,089.89	0.0067 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	2,197,160.97	0.2403 %
TOPLAM:	1,022.12	0.0001 %
	0.11	0.0000 %
	506.34	0.0001 %
	25.76	0.0000 %
	3,018,778.98	0.3302 %

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

18,844,980.000

5,617,580.14

661,650.000

187,351.83



FON RİSK RAPORU

30.11.2020

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	911,897,886.86
Fon Toplam Değeri	914,476,364.35
Risk Değeri	7
Fon Portföyü Standart Sapması	0.86

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

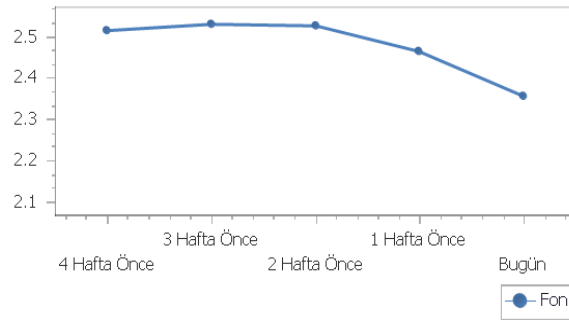
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	21,537,601.58			
RMD (%)	2.36			5.59
Beklenen Kayıp	21,739,561.20			
Beklenen Kayıp (%)	2.38			
Uç Değer Adedi	1			

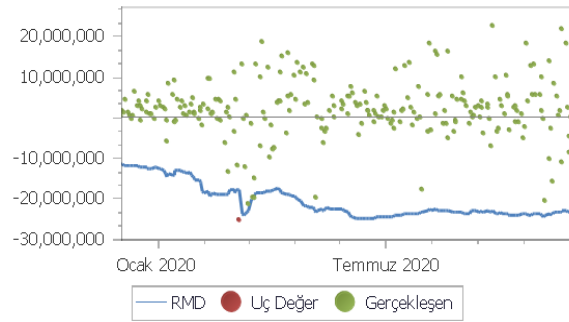
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	16,818,772	-167,374	-0.02
Takasbank Para Piyasası	444,195	-120	0.00
Ters Repo	18,007,792	-4,872	0.00
Eurobond	876,627,128	21,160,898	2.31
Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyükliği	Artık RMD	Artık RMD (%)

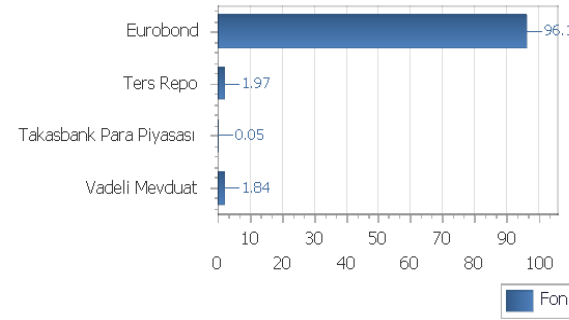
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

