

DPB-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON

Temmuz 2018

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DPB-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST 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	:	200,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	97,289,614.50
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	87,925,625.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.106499
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.090822
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.44
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	9.78
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	19.19
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	98.64
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) BPP	:	0.21
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	1.05
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.10
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	40.627
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	:	1,578.75

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS0849728190	01/11/22	3,000,000.00	12,164,240.27	12.49
XS1003016018	10/11/23	200,000.00	939,875.58	0.96
XS1175854923	03/02/25	9,500,000.00	40,286,328.41	41.38
XS1376681067	09/03/26	1,000,000.00	4,616,365.80	4.74
XS1584113184	29/03/27	4,000,000.00	15,686,949.79	16.11
XS1772360803	27/04/28	1,000,000.00	3,861,182.62	3.97
XS1623796072	29/06/28	5,000,000.00	19,171,872.97	19.69
TOPLAM:		23,700,000.00	96,726,815.44	99.34

MEVDUAT

Mevduat	01/08/18	35,872.38	175,778.28	0.18
TOPLAM:		35,872.38	175,778.28	0.18

BPP

BPP	01/08/18	471,232.92	471,232.92	0.48
TOPLAM:		471,232.92	471,232.92	0.48

PORTFÖY DEĞERİ:	24,207,105.30	97,373,826.64	100.00
-----------------	---------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
----------	-------	-------

A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	97,373,826.64	100.09 %
B-)HAZIR DEĞERLER	2,509.59	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-86,721.73	-0.09 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	97,289,614.50	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	103.50	0.0001 %
Fon Yönetim Ücreti	76,540.42	0.0787 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	238.50	0.0002 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	6,399.19	0.0066 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	44.04	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	632.82	0.0007 %
BİST KYD Ücreti	1,243.50	0.0013 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	29.75	0.0000 %
TOPLAM:	85,231.72	0.0876 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ 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
TL	0.000	0.00	58,007,839.000	65,795,133.45

DPB - Deniz Portföy Birinci Serbest Fon-31.07.2018 Risk Bildirim Tablosu				
Fon Portföy Değeri	97,373,826.64			
Fon Toplam Değeri	97,289,614.50			
Risk Değeri	6			
Fon Portföyü Standart Sapması	1.15			
Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi				
Açık Pozisyon Tutarı				
Kaldıraç Oranı		Limit : 5.00		
RMD Özeti				
	Fon			Limit
RMD	2,137,891.39			
RMD (%)	2.20			5.59
Beklenen Kayıp	3,111,926.41			
Beklenen Kayıp (%)	3.20			
Uç Değer Adedi	5			
RMD Kırılımı				
Piyasa	Büyüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Takasbank Para Piyasası	471,233	-196	0.00	
Vadeli Mevduat	175,778	5,208	0.01	
Eurobond	96,726,815	2,133,774	2.19	