

DPB-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON

Haziran 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	:	32,634,971.81
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	29,917,786.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.090822
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.139618
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-4.28
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	8.23
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	20.02
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	97.59
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) BPP	:	2.10
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.24
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.07
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	14.884
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.02
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1,562.05

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1003016018	10/11/23	200,000.00	896,327.03	2.08
XS1175854923	03/03/25	2,600,000.00	10,922,561.79	25.42
XS1376681067	09/03/26	200,000.00	920,082.26	2.14
XS1584113184	29/03/27	1,750,000.00	7,107,610.66	16.54
XS1772360803	27/04/28	200,000.00	799,743.50	1.86
XS1623796072	29/06/28	2,700,000.00	10,554,725.37	24.55
US900123BG46	30/05/40	230,000.00	967,721.71	2.25
XS1175854923	03/03/25	400,000.00	1,681,261.52	3.91
XS1376681067	09/03/26	800,000.00	3,682,888.88	8.57
XS1584113184	29/03/27	250,000.00	1,016,019.45	2.36
XS1772360803	27/04/28	800,000.00	3,200,822.48	7.45
XS1623796072	29/06/28	300,000.00	1,173,474.96	2.73
TOPLAM:		10,430,000.00	42,923,239.61	99.86

MEVDUAT

Mevduat	02/07/18	6,915.08	31,541.48	0.07
TOPLAM:		6,915.08	31,541.48	0.07

TÜREV

USD/TRY 4,5623 40148	04/07/18	13,691,846.66	30,875.11	0.07
TOPLAM:		13,691,846.66	30,875.11	0.07

PORTFÖY DEĞERİ:	24,128,761.74	42,985,656.20	100.00
-----------------	---------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	42,985,656.20	131.72 %
B-)HAZIR DEĞERLER	436,102.47	1.34 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-10,786,786.86	-33.05 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %

G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	32,634,971.81	
		100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	322.61	0.0010 %
Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	28,614.28	0.0877 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	246.45	0.0008 %
Kayda Alma Ücreti	1,631.75	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin	2,791.50	0.0086 %
Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	41.44	0.0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	625.89	0.0019 %
Diğer Harcamalar	0.02	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	370.45	0.0011 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	115.80	0.0004 %
TOPLAM:	34,760.19	0.1066 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA				
Sirketin Unvanı	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	1,002,307.000	1,166,274.40

DPB - Deniz Portföy Birinci Serbest Fon-29.06.2018 Risk Bildirim Tablosu				
Fon Portföy Değeri	42,985,656.20			
Fon Toplam Değeri	32,634,971.81			
Risk Değeri	6			
Fon Portföyü Standart Sapması	2.67			
Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi				
Açık Pozisyon Tutarı				
Kaldıraç Oranı		Limit : 5.00		
RMD Özeti				
	Fon			Limit
RMD	2,430,273.58			
RMD (%)	7.45			5.59
Beklenen Kayıp	2,664,691.32			
Beklenen Kayıp (%)	8.17			
Uç Değer Adedi	5			
RMD Kırılımı				
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Vadeli Mevduat	31,541	774	0.00	
Forward	76,613	1,466,334	4.49	
Eurobond	42,923,240	897,397	2.75	
Nakit	-45,738	0	0.00	
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Toplam	62,444,405	1,466,334	4.49	
USD/TRY 4,5623 40148	62,444,405	1,466,334	4.49	