

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON

Eylül-2019

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	:	388,692,935.55
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	248,086,765.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.566762
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.514750
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	3.43
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	24.78
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	23.69
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.80
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.02
f-) TPP	:	0.00
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.12
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.06
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	12.179
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.06
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	843.53

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1188073081	11/02/21	200,000.00	1,108,091.30	0.27
XS1867595750	15/01/24	9,400,000.00	58,845,210.55	14.19
XS1376681067	09/03/26	7,135,000.00	39,583,014.97	9.55
XS1584113184	29/03/27	15,700,000.00	80,001,165.32	19.30
XS1551747733	01/11/27	17,490,000.00	90,498,685.36	21.83
XS1623796072	29/06/28	22,110,000.00	115,257,719.21	27.78
XS0849728190	01/11/22	1,000,000.00	5,557,558.30	1.34
XS1376681067	09/03/26	7,530,000.00	41,784,409.00	10.08
XS1376681067	09/03/26	200,000.00	1,109,811.66	0.27
XS1376681067	09/03/26	-1,800,000.00	-9,988,304.94	-2.41
XS1551747733	01/11/27	-1,850,000.00	-9,574,521.64	-2.31
TOPLAM:		77,115,000.00	414,182,839.09	99.89
MEVDUAT				
Mevduat	01/10/19	28,495.66	160,826.66	0.04
Mevduat	01/10/19	278,000.00	278,111.20	0.07
TOPLAM:		306,495.66	438,937.86	0.11
PORTFÖY DEĞERİ:		77,421,495.66	414,621,776.95	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	414,621,776.95	106.67 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,380,358.44	0.87 %
C-)ALACAKLAR	19,733,777.11	5.08 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-49,042,976.95	-12.62 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	388,692,935.55	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	11.13	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	295,904.44	0.0761 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	301.89	0.0001 %
Kayda Alma Ücreti	19,434.65	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	25,265.90	0.0065 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	73.40	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	505.80	0.0001 %
BİST KYD Ücreti	497.35	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	3.33	0.0000 %
TOPLAM:	341,997.89	0.0879 %

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	14,353,418.000	3,824,927.39	16,663,919.000	4,496,642.70

DPB - Deniz Portföy Birinci Serbest (Döviz) Fon-30.09.2019 Risk Bildirim Tablosu				
Fon Portföy Değeri	414,621,776.95			
Fon Toplam Değeri	388,692,935.55			
Risk Değeri	5			
Fon Portföyü Standart Sapması	0.85			
Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi				
Açık Pozisyon Tutarı				
Kaldıraç Oranı				Limit : 5.00
RMD Özeti				
	Fon			Limit
RMD	10,808,467.80			
RMD (%)	2.78			5.59
Beklenen Kayıp	21,923,168.45			
Beklenen Kayıp (%)	5.64			
Uç Değer Adedi	1			
RMD Kırılımı				
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Vadeli Mevduat	438,938	600	0.00	
Eurobond	414,182,839	10,804,884	2.78	