

DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON

Eylül-2019

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	50,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	50,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	18,055,066.24
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	2,778,935.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	10 Nisan 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	6.497117
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	6.588089
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-1.38
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	-0.32
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.54
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) TPP	:	0.00
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.46
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	5.230
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	0.00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1909184753	16/02/26	2,633,000.00	17,482,999.70	96.74
TOPLAM:		2,633,000.00	17,482,999.70	96.74
MEVDUAT				
Mevduat	01/10/19	95,559.12	589,324.25	3.26
TOPLAM:		95,559.12	589,324.25	3.26
PORTFÖY DEĞERİ:		2,728,559.12	18,072,323.95	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	18,072,323.95	100.10 %
B-)HAZIR DEĞERLER	2,411.08	0.01 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-19,668.79	-0.11 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	18,055,066.24	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0.00	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	13,590.85	0.0753 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	347.42	0.0019 %
Kayda Alma Ücreti	902.75	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1,728.82	0.0096 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	61.56	0.0003 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	824.15	0.0046 %
TOPLAM:	17,455.55	0.0967 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE SENEDİ ALIM, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

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
EUR	0.000	0.00	274,475.000	285,669.99

DSD - Deniz Portföy İkinci Serbest (Döviz) Fon-30.09.2019 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	18,072,323.95
Fon Toplam Değeri	18,055,066.24
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.66

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	277,132.68			
RMD (%)	1.53			5.59
Beklenen Kayıp	318,357.36			
Beklenen Kayıp (%)	1.76			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyükük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	589,324	7,300	0.04
Eurobond	17,483,000	267,516	1.48