

DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON**Ş-2020****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	:	105,584,458.87
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	14,309,066.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	10 Nisan 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	7.378851
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	7.480174
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-1.35
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0.45
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.11
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	:	0.89
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	25.402
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	:	0.00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Devlet Tahvili				
TRT171221F16	17/12/21	160,000.00	1,100,766.09	1.04
Eurobond				
XS1909184753	16/02/26	12,420,000.00	89,832,921.46	85.01
	TOPLAM:	12,580,000.00	90,933,687.55	86.05
MEVDUAT				
Mevduat	02/03/20	2,146,674.28	14,724,480.29	13.94

Mevduat	02/03/20	7,000.00	7,005.74	0.01
TOPLAM:		2,153,674.28	14,731,486.03	13.95
PORTFÖY DEĞERİ:		14,733,674.28	105,665,173.58	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	105,665,173.58	100.08 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1,782.39	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-82,497.10	-0.08 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	105,584,458.87	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0.00	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	72,642.45	0.0688 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	244.44	0.0002 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	6,003.35	0.0057 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	187.30	0.0002 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	629.72	0.0006 %
Diğer Harcamalar	118.56	0.0001 %
BİST KYD Ücreti	465.07	0.0004 %
TOPLAM:	80,290.89	0.0760 %

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
EUR	249,956.000	278,952.03	3,888,962.000	4,372,070.04



FON RİSK RAPORU

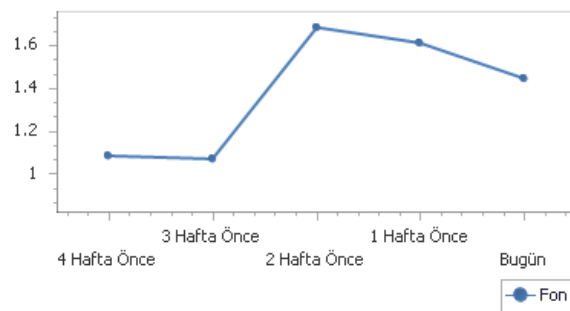
28.02.2020

DSD - Deniz Portföy İkinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	105,665,173.58
Fon Toplam Değeri	105,584,458.87
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.62

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1.536.334.10			

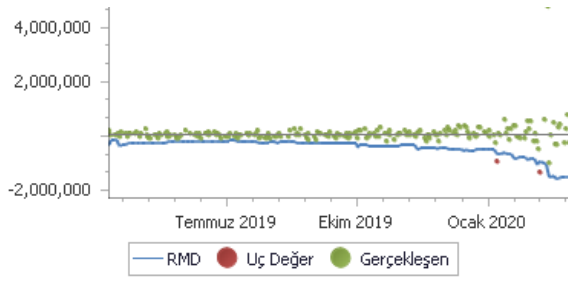
Geriye Dönük Test

--	--	--	--	--

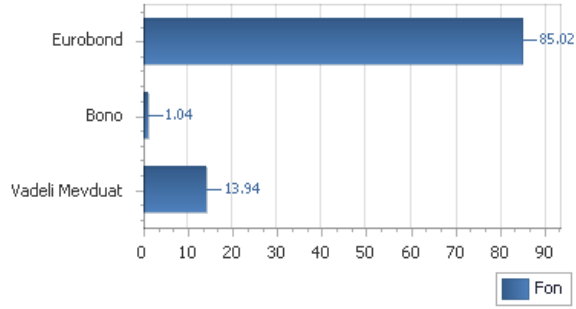
RMD	1,526,224.10			
RMD (%)	1.45			5.59
Beklenen Kayıp	1,753,256.47			
Beklenen Kayıp (%)	1.66			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	14,731,486	61,616	0.06
Bono	1,100,766	1,100	0.00
Eurobond	89,832,921	1,353,270	1.28
Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

