

DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON**M-2020****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	200,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	125,605,095.14
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	17,869,128.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	18 Mayıs 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	7.029168
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	7.029168
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.00
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.47
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.30
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	:	0.70
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	7.788
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.16
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	211.19

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS0847042024	24/10/22	820,000.00	5,553,764.26	4.22
XS0849728190	01/11/22	870,000.00	5,839,327.66	4.43
XS0861979440	06/12/22	1,300,000.00	8,770,371.90	6.66
XS1003016018	11/12/23	200,000.00	1,420,978.57	1.08
US900123CR91	25/12/23	8,900,000.00	64,349,844.08	48.85
XS1970705528	28/03/24	5,000,000.00	35,356,540.13	26.84
US900123CR91	25/12/23	600,000.00	4,338,191.76	3.29
US900123CR91	25/12/23	250,000.00	1,807,579.90	1.37

TOPLAM: 17,940,000.00 127,436,598.26 96.74

MEVDUAT

Mevduat	01/06/20	629,301.81	4,287,971.83	3.26
TOPLAM:		629,301.81	4,287,971.83	3.26
PORTFÖY DEĞERİ:		18,569,301.81	131,724,570.09	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	131,724,570.09	104.87 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0.00	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-6,119,474.95	-4.87 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	125,605,095.14	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0.00	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	42,248.85	0.0336 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	235.90	0.0002 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	2,786.44	0.0022 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	452.65	0.0004 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	0.20	0.0000 %
Diğer Harcamalar	0.20	0.0000 %
TOPLAM:	45,724.04	0.0364 %

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	0.000	0.00	17,869,128.000	17,984,531.52



FON RİSK RAPORU

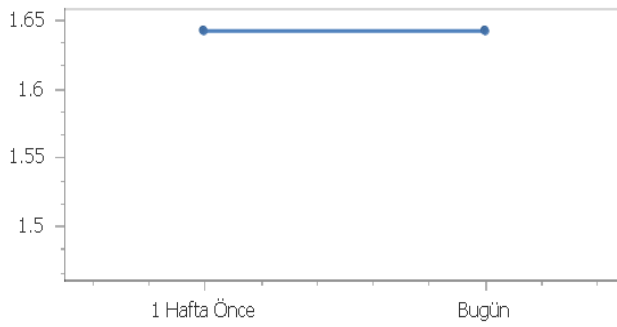
29.05.2020

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	131,724,570.09
Fon Toplam Değeri	125,605,095.14
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.67

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

Fon	Kıstas	Görelî	Limit
-----	--------	--------	-------

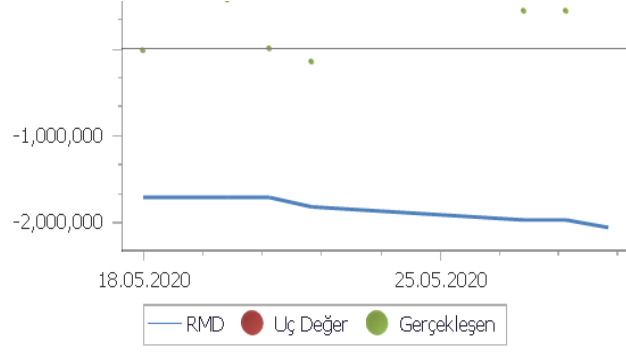
Geriyeye Dönük Test



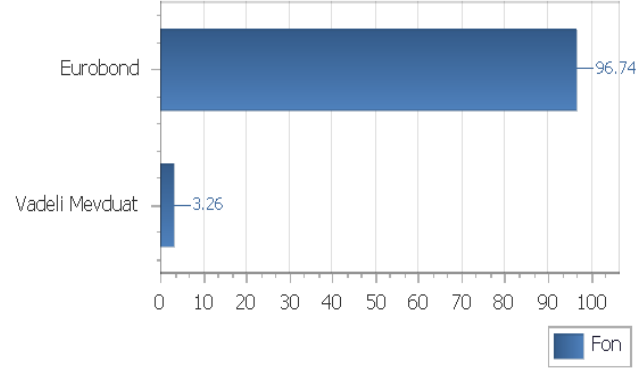
RMD	2,061,550.90			
RMD (%)	1.64			5.59
Beklenen Kayıp	2,368,215.43			
Beklenen Kayıp (%)	1.89			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	4,287,972	37,251	0.03
Eurobond	127,436,598	1,993,553	1.59
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

