

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**M-2020****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	:	922,386,200.60
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	483,412,314.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.908073
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.883309
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.31
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	7.50
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	41.07
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.92
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	:	0.07
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.01
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	24.082
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	:	889.16

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1439838548	13/07/21	900,000.00	6,163,654.71	0.67
XS1867595750	15/01/24	21,441,000.00	163,244,974.95	17.61
US900123CW86	14/11/24	1,000,000.00	6,612,781.81	0.71
XS2100270508	23/01/25	1,000,000.00	6,586,904.85	0.71
US900123CL22	25/03/27	1,300,000.00	8,534,070.92	0.92
XS1584113184	29/03/27	16,920,000.00	107,032,889.20	11.55
XS1551747733	01/11/27	16,908,000.00	106,148,255.61	11.45
XS1623796072	29/06/28	13,184,000.00	83,113,922.42	8.97

XS2106022754	22/01/30	41,081,000.00	263,677,004.12	28.44
US900123BB58	05/03/38	2,500,000.00	16,514,469.29	1.78
US900123CG37	17/02/45	15,000,000.00	90,006,705.92	9.71
US900123CM05	13/05/47	11,820,000.00	63,292,521.47	6.83
XS1376681067	09/03/26	735,000.00	4,968,695.55	0.54
XS2106022754	22/01/30	-200,000.00	-1,283,928.50	-0.14
TOPLAM:		143,589,000.00	924,612,922.32	99.75

MEVDUAT

Mevduat	01/06/20	333,410.74	2,271,812.70	0.25
TOPLAM:		333,410.74	2,271,812.70	0.25

TPP

TPP	01/06/20	44,032.01	44,032.01	0.00
TOPLAM:		44,032.01	44,032.01	0.00

PORTFÖY DEĞERİ:		143,966,442.75	926,928,767.03	100.00
-----------------	--	----------------	----------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	926,928,767.03	100.49 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,994.29	0.00 %
C-)ALACAKLAR	1,312,612.34	0.14 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-5,859,173.06	-0.64 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	922,386,200.60	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar Fon Yönetim Ücreti	14.95	0.0000 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri Kayda Alma Ücreti	701,752.70	0.0761 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	244.44	0.0000 %
Ödenen Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti Diğer Harcamalar	14,234.84	0.0015 %
BİST KYD Ücreti	58,337.33	0.0063 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	487.38	0.0001 %
TOPLAM:	422.52	0.0000 %
	0.14	0.0000 %
	488.88	0.0001 %
	2.45	0.0000 %
	775,985.63	0.0841 %

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	18,894,472.000	5,167,958.80	20,224,070.000	5,568,712.44



Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	926,928,767.03
Fon Toplam Değeri	922,386,200.60
Risk Değeri	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.90

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

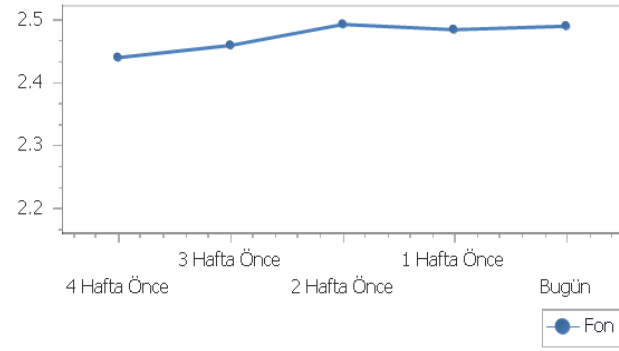
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	22,951,845.05			
RMD (%)	2.49			5.59
Beklenen Kayıp	22,978,106.43			
Beklenen Kayıp (%)	2.49			
Uç Değer Adedi	1			

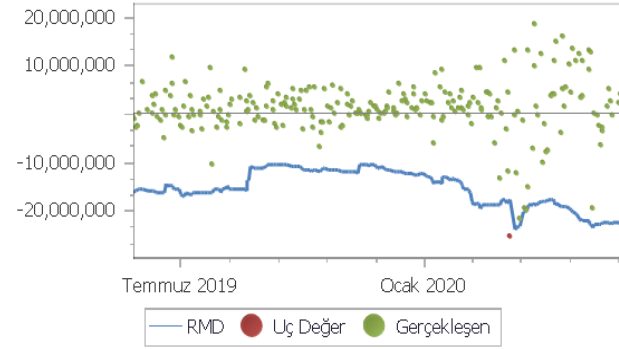
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	2,271,813	-22,608	0.00
Takasbank Para Piyasası	44,032	-12	0.00
Eurobond	924,612,922	22,909,758	2.48
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)

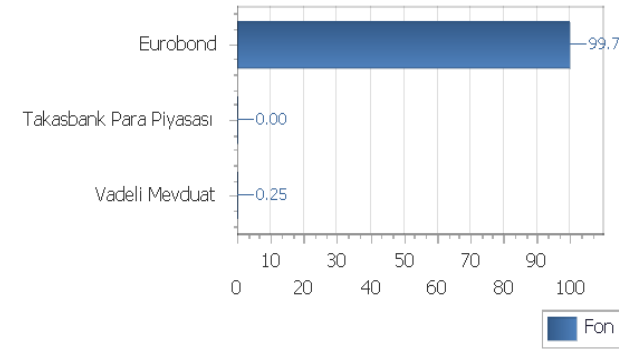
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

