

DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON**H-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	:	135,893,303.59
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	18,993,244.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	18 Mayıs 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	7.154823
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	7.029168
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.79
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.61
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.62
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	:	0.38
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	9.823
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	:	298.49

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1188073081	11/02/21	1,000,000.00	6,925,511.28	4.83
XS0847042024	24/10/22	440,000.00	3,019,221.33	2.11
XS0849728190	01/11/22	870,000.00	5,909,261.32	4.12
XS0861979440	06/12/22	1,300,000.00	8,758,141.38	6.11
XS1003016018	11/12/23	200,000.00	1,392,473.48	0.97
US900123CR91	25/12/23	9,750,000.00	69,697,302.98	48.62
XS1970705528	28/03/24	5,000,000.00	35,997,850.18	25.11
US900123CW86	14/11/24	1,000,000.00	6,800,601.63	4.74

TOPLAM: 19,560,000.00 138,500,363.58 96.61

MEVDUAT

Mevduat	01/07/20	709,415.97	4,854,695.28	3.39
Mevduat	01/07/20	5,000.00	5,000.94	0.00
TOPLAM:		714,415.97	4,859,696.22	3.39
PORTFÖY DEĞERİ:		20,274,415.97	143,360,059.80	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	143,360,059.80	105.49 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1,249.28	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-7,087,616.43	-5.22 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-380,389.06	-0.28 %
FON TOPLAM DEĞERİ	135,893,303.59	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0.00	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	115,858.82	0.0853 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	505.50	0.0004 %
Kayda Alma Ücreti	3,285.25	0.0024 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	10,148.67	0.0075 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	380,450.31	0.2800 %
Ödenen Denetim Ücreti	985.20	0.0007 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına		
Ödenen Denetim Ücreti	-0.07	0.0000 %
Diğer Harcamalar		
TOPLAM:	511,233.68	0.3763 %

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	2,591,854.000	2,714,423.51	3,715,970.000	3,872,358.73



FON RİSK RAPORU

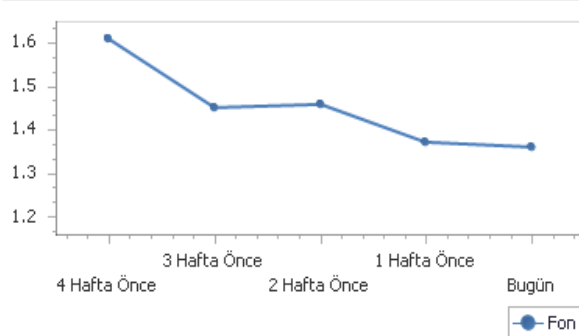
30.06.2020

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	143,298,261.04
Fon Toplam Değeri	135,954,497.99
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.55

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

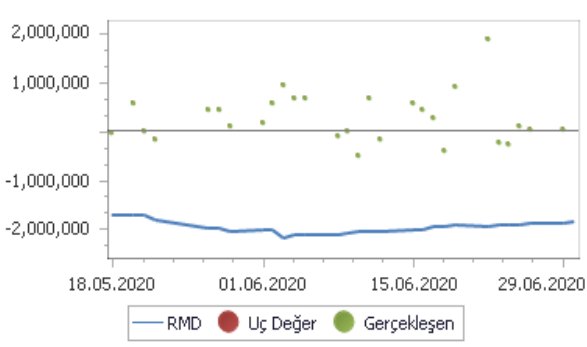
RMD Özeti

Geriye Dönük Test

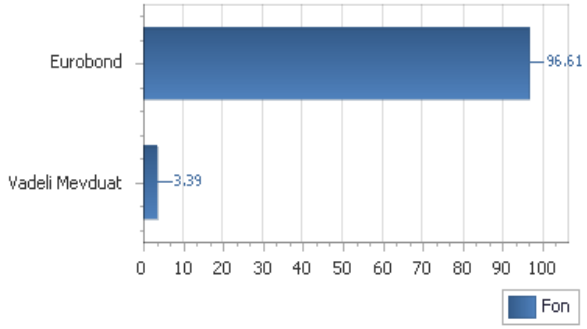
	Fon	Kıstas	Görelî	Lîmit
RMD	1,847,723.43			
RMD (%)	1.36			5.59
Beklenen Kayıp	2,122,580.20			
Beklenen Kayıp (%)	1.56			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	4,859,696	31,128	0.02
Eurobond	138,500,364	1,786,952	1.31
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyükliğı	Artık RMD	Artık RMD (%)



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

