

**DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON****E-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      | : | 144,347,925.05                               |
| G-)Tedavüldeki Pay Sayısı | : | 18,111,431.000                               |
| H-)Fonun Kuruluş Tarihi   | : | 18 Mayıs 2020                                |
| I-)Fonun Süresi           | : | Süresizdir.                                  |

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

|                                      |   |          |
|--------------------------------------|---|----------|
| A-)Ay Sonu Pay Fiyatı                | : | 7.969990 |
| B-)Önceki Ay Pay Fiyatı              | : | 7.589171 |
| C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı      | : | 5.02     |
| D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı  | : | 4.66     |
| E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı     | : |          |
| F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi    | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 0.00     |
| b-)Hazine Bonosu                     | : | 0.00     |
| c-)Devlet Tahvili                    | : | 99.31    |
| 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                          | : | 0.69     |
| k-) Katılım Hesabı                   | : | 0.00     |
| l-)Diğer                             | : | 0.00     |
| G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı      | : | 9.099    |
| 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         | : | 218.72   |

**III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU**

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

**BORÇLANMA SENETLERİ**

|                 |          |              |               |       |
|-----------------|----------|--------------|---------------|-------|
| <b>Eurobond</b> |          |              |               |       |
| XS1188073081    | 11/02/21 | 1,000,000.00 | 7,759,524.33  | 5.26  |
| XS0847042024    | 24/10/22 | 440,000.00   | 3,391,579.27  | 2.30  |
| XS0849728190    | 01/11/22 | 870,000.00   | 6,699,112.10  | 4.54  |
| XS0861979440    | 06/12/22 | 1,300,000.00 | 9,876,166.92  | 6.69  |
| XS1003016018    | 11/12/23 | 200,000.00   | 1,599,900.75  | 1.09  |
| US900123CR91    | 25/12/23 | 8,850,000.00 | 72,169,988.26 | 48.92 |

|              |          |               |                |       |
|--------------|----------|---------------|----------------|-------|
| XS1970705528 | 28/03/24 | 4,120,000.00  | 32,176,540.84  | 21.81 |
| US900123CW86 | 14/11/24 | 1,000,000.00  | 7,694,304.96   | 5.22  |
|              | TOPLAM:  | 17,780,000.00 | 141,367,117.43 | 95.83 |

#### MEVDUAT

|                 |          |               |                |        |
|-----------------|----------|---------------|----------------|--------|
| Mevduat         | 01/10/20 | 788,389.64    | 6,111,787.58   | 4.14   |
| Mevduat         | 01/10/20 | 43,000.00     | 43,012.92      | 0.03   |
|                 | TOPLAM:  | 831,389.64    | 6,154,800.50   | 4.17   |
| PORTFÖY DEĞERİ: |          | 18,611,389.64 | 147,521,917.93 | 100.00 |

#### IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

| AÇIKLAMA              | TUTAR          | ORAN%    |
|-----------------------|----------------|----------|
| A-)FON PORTFÖY DEĞERİ | 147,521,917.93 | 102.20 % |
| B-)HAZIR DEĞERLER     | 5,130.88       | 0.00 %   |
| C-)ALACAKLAR          | 0.00           | 0.00 %   |
| D-)DİĞER VARLIKLAR    | 0.00           | 0.00 %   |
| E-)BORÇLAR            | -135,649.97    | -0.09 %  |
| F-)İHTİYAT            | 0.00           | 0.00 %   |
| G-)VERGİ              | -3,043,473.79  | -2.11 %  |
| FON TOPLAM DEĞERİ     | 144,347,925.05 | 100,00 % |

#### V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| AÇIKLAMA                                                       | TUTAR        | ORAN%    |
|----------------------------------------------------------------|--------------|----------|
| Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar | 0.00         | 0.0000 % |
| Fon Yönetim Ücreti                                             | 116,361.68   | 0.0806 % |
| Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri      | 505.50       | 0.0004 % |
| Kayda Alma Ücreti                                              | 2,706.72     | 0.0019 % |
| Portföydeki Varlıkların Saklanması                             | 11,321.22    | 0.0078 % |
| Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler                                |              |          |
| Fonun Mükellefi Olduğu Vergi                                   | 1,236,710.75 | 0.8568 % |
| Ödenen Denetim Ücreti                                          | 1,248.32     | 0.0009 % |
| Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti           |              |          |
| TOPLAM:                                                        | 1,368,854.19 | 0.9484 % |

#### 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         | 2,466,108.000 | 2,556,437.01 | 1,521,988.000 | 1,576,954.35 |



#### FON RİSK RAPORU

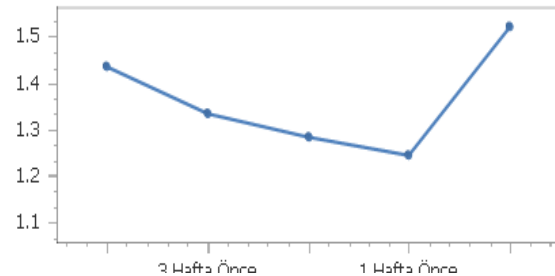
30.09.2020

#### DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

##### Fon Bilgileri

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| Fon Portföy Değeri            | 149,433,962.83 |
| Fon Toplam Değeri             | 145,073,663.00 |
| Risk Değeri                   | 5              |
| Fon Portföyü Standart Sapması | 0.64           |

##### Fon RMD Trendi



### Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bütçesi

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| Açık Pozisyon Tutarı | Limit : 1.00 |
| Kaldıraç Oranı       | Limit : 5.00 |

### RMD Özeti

|                    | Fon          | Kıstas | Görelî | Limit |
|--------------------|--------------|--------|--------|-------|
| RMD                | 2,207,955.58 |        |        |       |
| RMD (%)            | 1.52         |        |        | 5.59  |
| Beklenen Kayıp     | 2,536,398.43 |        |        |       |
| Beklenen Kayıp (%) | 1.75         |        |        |       |
| Uç Değer Adedi     | 1            |        |        |       |

### RMD Kırılımı

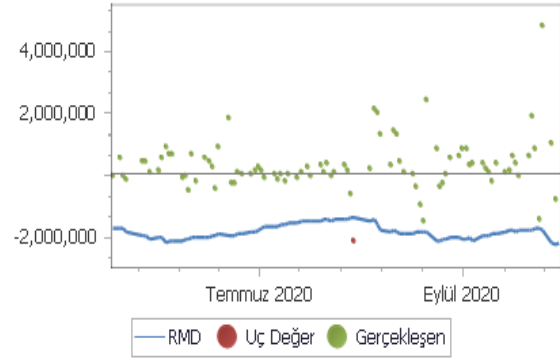
| Piyasa         | Büyüklik    | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|----------------|-------------|-----------|---------------|
| Vadeli Mevduat | 6,154,801   | 83,051    | 0.06          |
| Eurobond       | 141,367,117 | 2,109,400 | 1.45          |

| Kaldıraç Yaratıcı İşlemler | Sözleşme Büyükliği | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|----------------------------|--------------------|-----------|---------------|
|----------------------------|--------------------|-----------|---------------|

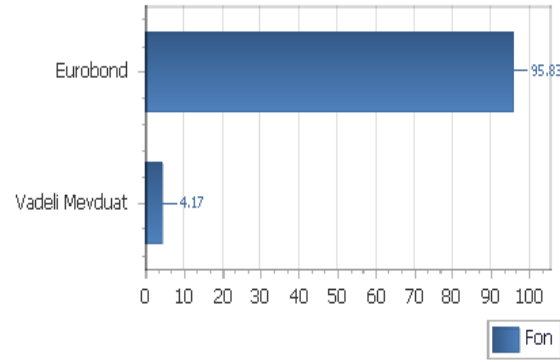
4 Hafta Önce 3 Hafta Önce 2 Hafta Önce 1 Hafta Önce Bugün

Fon

### Geriye Dönük Test



### Fon Varlık Kırılımı



### Stress Testi

