

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**A-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	:	755,018,228.53
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	324,999,071.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	2.323140
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	2.364768
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-1.76
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	30.88
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	30.88
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	97.74
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	2.03
f-) TPP	:	0.08
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.13
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.02
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	17.209
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	:	831.97

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	17,000,000.00	149,712,370.92	18.75
XS1584113184	29/03/27	14,460,000.00	107,404,849.34	13.45
XS1551747733	01/11/27	10,000,000.00	75,555,211.67	9.46
XS1623796072	29/06/28	8,444,000.00	61,496,951.57	7.70
XS2106022754	22/01/30	29,421,000.00	225,045,155.12	28.19
US900123BB58	05/03/38	1,000,000.00	8,549,286.34	1.07
US900123CG37	17/02/45	11,900,000.00	94,964,947.92	11.89
US900123CM05	13/05/47	6,650,000.00	47,581,945.53	5.96

US900123CM05	13/05/47	1,350,000.00	9,661,163.36	1.21
	TOPLAM:	100,225,000.00	779,971,881.77	97.68

T.REPO

TRT160425T33	04/01/21	17,160,955.00	17,033,441.10	2.13
	TOPLAM:	17,160,955.00	17,033,441.10	2.13

MEVDUAT

Mevduat	04/01/21	20,151.35	149,514.19	0.02
	TOPLAM:	20,151.35	149,514.19	0.02

TPP

TPP	04/01/21	872,694.27	872,694.27	0.11
	TOPLAM:	872,694.27	872,694.27	0.11

TÜREV

USD/TRY 7,7465 45683	27/01/21	-1,000,000.00	264,150.67	0.03
USD/TRY 7,7525 45676	27/01/21	-1,000,000.00	270,150.67	0.03
	TOPLAM:	-2,000,000.00	534,301.34	0.06
PORTFÖY DEĞERİ:		116,278,800.62	798,561,832.67	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	798,561,832.67	105.77 %
B-)HAZIR DEĞERLER	10,121.48	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-10,497,069.92	-1.39 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-33,056,655.70	-4.38 %
FON TOPLAM DEĞERİ	755,018,228.53	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	3,551.34	0.0005 %
Fon Yönetim Ücreti	754,610.30	0.0999 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	270.63	0.0000 %
Kayda Alma Ücreti	6,584.44	0.0009 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	62,278.10	0.0082 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	-2,321,968.60	-0.3075 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	726.95	0.0001 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	-0.07	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	541.26	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	90.97	0.0000 %
TOPLAM:	-1,493,314.68	-0.1978 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE 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

64,917,682.000

19,850,713.37

3,208,072.000

1,000,299.77



FON RİSK RAPORU

12.31.2020

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	798,561,832.67
Fon Toplam Değeri	755,018,228.53
Risk Değeri	7
Fon Portföyü Standart Sapması	0.73

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.02	Limit : 5.00

RMD Özeti

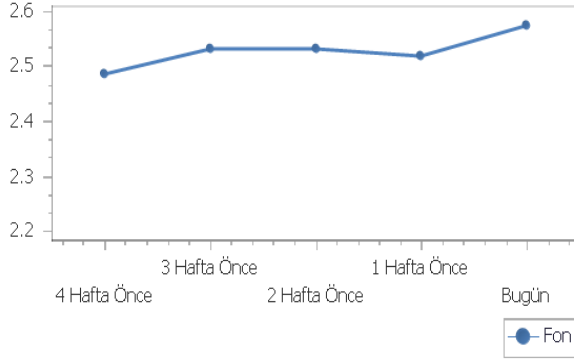
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	19,431,981.65			
RMD (%)	2.57			5.59
Beklenen Kayıp	19,769,280.98			
Beklenen Kayıp (%)	2.62			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

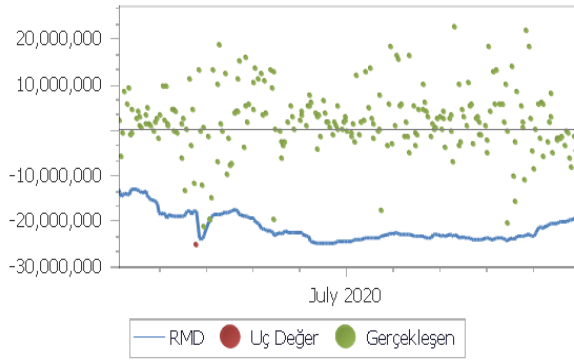
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	149,514	37	0.00
Takasbank Para Piyasası	872,694	-229	0.00
Forward	472,626	-3,679	0.00
Ters Repo	17,033,441	-4,471	0.00
Eurobond	779,971,882	19,088,929	2.53
Nakit	61,676	0	0.00

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-14,838,800	-3,679	0.00
USD/TRY 7,7465 45683	-7,419,400	-1,839	0.00

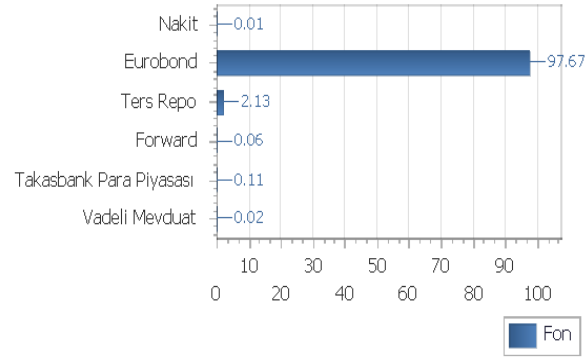
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



USD/TRY 7,7525 45676	-7,419,400	-1,839	0.00
----------------------	------------	--------	------

Stress Testi

