

DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON**O-2021****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DSD-DENİZ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	50,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	50,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	85,828,540.71
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	8,785,955.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	10 Nisan 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	9.768835
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	9.984845
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-2.16
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	-2.16
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	30.60
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	94.22
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.26
f-) TPP	:	0.13
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	5.39
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	18.280
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	:	21.60

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1843443356	31/03/25	2,171,000.00	21,252,312.46	24.34
XS1909184753	16/02/26	6,290,000.00	63,585,795.17	72.84
XS1909184753	16/02/26	-290,000.00	-2,932,311.95	-3.36
	TOPLAM:	8,171,000.00	81,905,795.68	93.82
MEVDUAT				
Mevduat	01/02/21	24,709.54	219,218.98	0.25
Mevduat	24/02/21	5,000,000.00	5,068,030.67	5.80
	TOPLAM:	5,024,709.54	5,287,249.65	6.05

TPP

TPP	01/02/21	109,152.75	109,152.75	0.13
	TOPLAM:	109,152.75	109,152.75	0.13
PORTFÖY DEĞERİ:		13,304,862.29	87,302,198.08	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	87,302,198.08	101.72 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,316.04	0.01 %
C-)ALACAKLAR	2,922,110.71	3.40 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-85,984.68	-0.10 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-4,315,099.44	-5.03 %
FON TOPLAM DEĞERİ	85,828,540.71	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	82.71	0.0001 %
Fon Yönetim Ücreti	69,170.39	0.0806 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	244.44	0.0003 %
Kayda Alma Ücreti	1,454.39	0.0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	7,867.55	0.0092 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	66.48	0.0001 %
Ödemeleri		
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	665.62	0.0008 %
Ödenen Denetim Ücreti		
BİST KYD Ücreti	307.72	0.0004 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	17.80	0.0000 %
TOPLAM:	79,877.10	0.0932 %

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
EUR	550,478.000	604,927.13	14,587.000	15,999.40



FON RİSK RAPORU

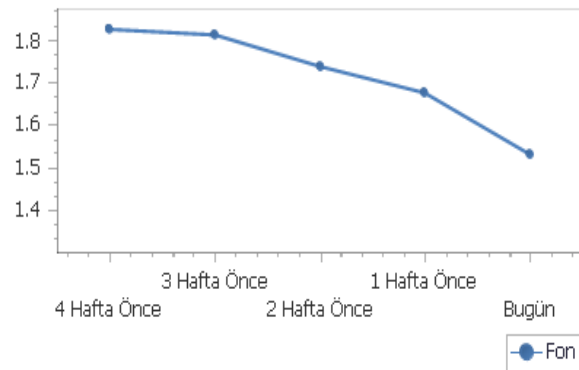
29.01.2021

DSD - Deniz Portföy İkinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	87,302,198.08
Fon Toplam Değeri	85,828,540.71
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.65

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

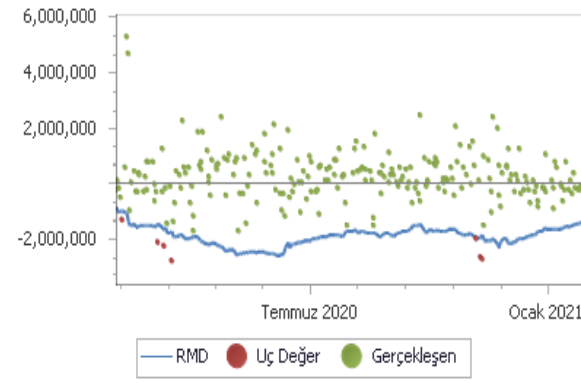
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1,315,316.98			
RMD (%)	1.53			5.59
Beklenen Kayıp	1,510,976.01			
Beklenen Kayıp (%)	1.76			
Uç Değer Adedi	7			

RMD Kırılımı

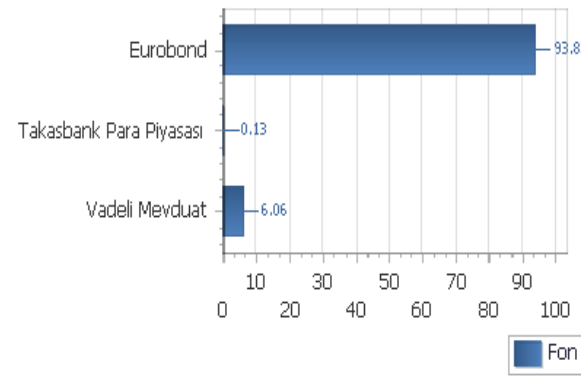
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	5,287,250	4,596	0.01
Takasbank Para Piyasası	109,153	19	0.00
Eurobond	81,905,796	1,305,928	1.52

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyükliğı	Artık RMD	Artık RMD (%)
---------------------------	--------------------	-----------	---------------

Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

