

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**O-2021****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	:	698,986,846.61
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	300,725,457.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	2.324335
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	2.323140
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.05
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0.05
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	22.63
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	97.05
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.41
f-) TPP	:	0.04
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	2.43
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.07
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	15.702
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.03
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1,471.35

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	15,000,000.00	127,833,216.88	17.72
XS1584113184	29/03/27	13,295,000.00	99,863,515.92	13.85
XS1551747733	01/11/27	9,750,000.00	73,508,870.71	10.19
XS2106022754	22/01/30	21,566,000.00	159,505,452.01	22.12
XS2286436451	22/01/31	6,750,000.00	50,764,963.52	7.04
US900123BB58	05/03/38	1,000,000.00	8,302,423.32	1.15
US900123CG37	17/02/45	11,000,000.00	84,347,135.96	11.70
US900123CM05	13/05/47	12,000,000.00	81,813,589.19	11.34

XS2286436451	22/01/31	2,000,000.00	15,041,470.60	2.09
US900123CM05	13/05/47	3,000,000.00	20,453,397.30	2.84
XS1867595750	15/01/24	-5,000,000.00	-42,611,072.50	-5.91
XS2106022754	22/01/30	-200,000.00	-1,479,267.46	-0.21
XS2286436451	22/01/31	-350,000.00	-2,632,396.17	-0.37
TOPLAM:		89,811,000.00	674,711,299.28	93.55

T.REPO

TRT120325T12	01/02/21	17,784,285.00	15,020,958.90	2.08
TOPLAM:		17,784,285.00	15,020,958.90	2.08

MEVDUAT

Mevduat	01/02/21	1,872,120.32	13,707,141.42	1.90
Mevduat	24/02/21	17,000,000.00	17,231,304.28	2.39
TOPLAM:		18,872,120.32	30,938,445.70	4.29

TPP

TPP	01/02/21	580,812.79	580,812.79	0.08
TOPLAM:		580,812.79	580,812.79	0.08

PORTFÖY DEĞERİ:	127,048,218.11	721,251,516.67	100.00
-----------------	----------------	----------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	721,251,516.67	103.19 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,590.90	0.00 %
C-)ALACAKLAR	46,662,603.33	6.68 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-35,876,208.59	-5.13 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-33,056,655.70	-4.73 %
FON TOPLAM DEĞERİ	698,986,846.61	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar Fon Yönetim Ücreti	630.26	0.0001 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri Kayda Alma Ücreti	577,346.67	0.0826 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	244.44	0.0000 %
Ödenen Denetim Kuruluşlarına	11,717.68	0.0017 %
Ödenen Denetim Ücreti Diğer Harcamalar	50,748.53	0.0073 %
BİST KYD Ücreti	83.20	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	728.46	0.0001 %
TOPLAM:	-0.22	0.0000 %
	488.88	0.0001 %
	41.75	0.0000 %
	642,029.65	0.0919 %

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

26,375,497.000

8,282,675.40

2,101,883.000

658,220.60



FON RİSK RAPORU

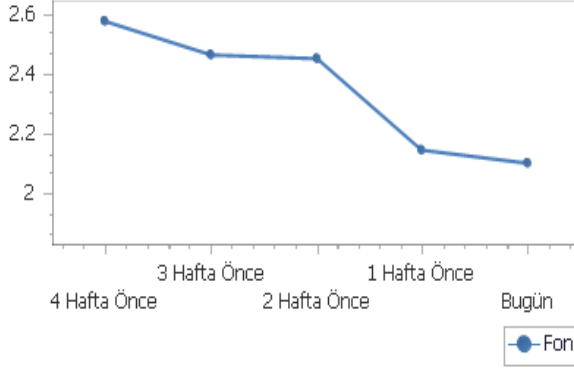
29.01.2021

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	721,251,516.67
Fon Toplam Değeri	698,986,846.61
Risk Değeri	7
Fon Portföyü Standart Sapması	0.66

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

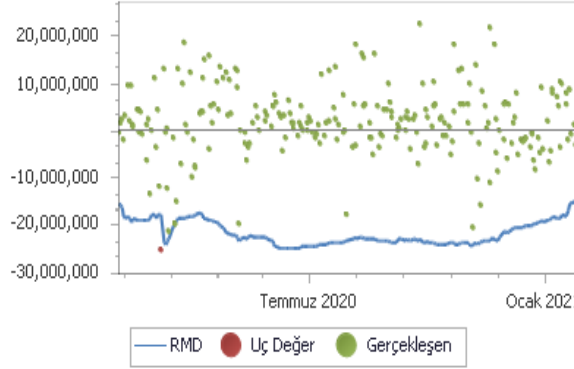
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	14,696,333.76			
RMD (%)	2.10			5.59
Beklenen Kayıp	17,132,072.53			
Beklenen Kayıp (%)	2.45			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

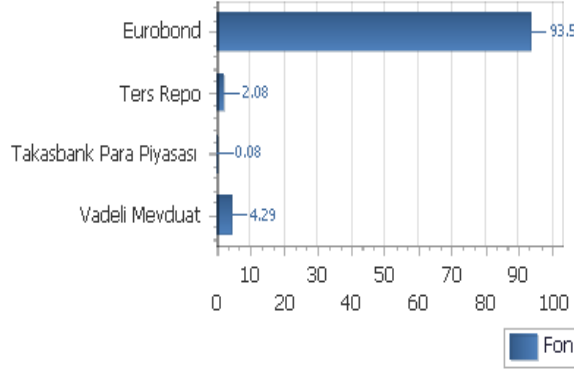
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	30,938,446	-188,171	-0.03
Takasbank Para Piyasası	580,813	-447	0.00
Ters Repo	15,020,959	-11,570	0.00
Eurobond	674,711,299	14,396,486	2.06

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
----------------------------	--------------------	-----------	---------------

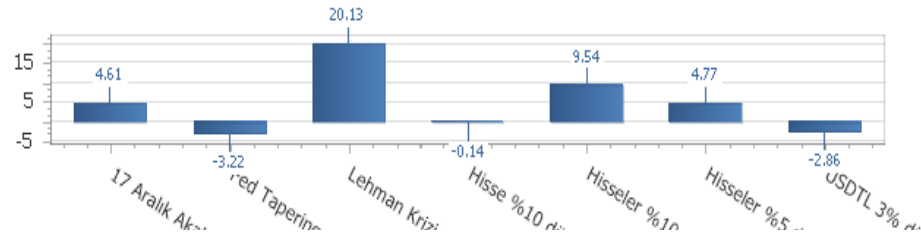
Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi



anabı

g ve Gezi

ı

düşüş, faizler 50bps düşüş, hisse 5% artış
düşüş, Faiz 50 bps artış, TL %5 değer kaybı
düşüş, Faiz 100 bps artış, TL %10 değer kaybı
düşüş Ebond/Y Hisse %5 düşüş SGMK +150 bps Fx %5 artış