

DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON**O-2021****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	:	88,435,859.24
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	10,879,320.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	18 Mayıs 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	8.128804
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	8.119393
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.12
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0.12
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	93.27
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.28
f-) TPP	:	0.06
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	6.39
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	5.303
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	:	267.91

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Eurobond				
XS1188073081	11/02/21	1,000,000.00	7,484,597.09	8.11
XS0849728190	01/11/22	400,000.00	3,012,468.51	3.27
XS0861979440	06/12/22	1,300,000.00	9,693,781.60	10.51
XS1003016018	11/12/23	200,000.00	1,572,138.12	1.70
XS1867595750	15/01/24	1,300,000.00	11,078,878.80	12.01
XS1970705528	28/03/24	4,120,000.00	33,473,920.22	36.27
US900123CW86	14/11/24	1,000,000.00	7,803,236.52	8.46
XS2281369301	14/01/26	1,000,000.00	7,403,222.27	8.02

TOPLAM: 10,320,000.00 81,522,243.13 88.35

MEVDUAT

Mevduat	01/02/21	768,275.88	5,625,101.15	6.10
Mevduat	24/02/21	5,000,000.00	5,068,030.67	5.49
TOPLAM:		5,768,275.88	10,693,131.82	11.59

TPP

TPP	01/02/21	53,074.27	53,074.27	0.06
TOPLAM:		53,074.27	53,074.27	0.06

PORTFÖY DEĞERİ: 16,141,350.15 92,268,449.22 100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	92,268,449.22	104.33 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,587.55	0.01 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-82,546.96	-0.09 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-3,755,630.57	-4.25 %
FON TOPLAM DEĞERİ	88,435,859.24	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	66,406.84	0.0751 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	471.80	0.0005 %
Tescil ve İlan Giderleri	1,389.13	0.0016 %
Kayda Alma Ücreti	8,042.64	0.0091 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	51.17	0.0001 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	66.35	0.0001 %
Portföye Alımlarda ve portföyden	1,162.75	0.0013 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar	-0.07	0.0000 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	7.43	0.0000 %
Ödemeleri	77,598.04	0.0878 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına		
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar		
Otomatik BPP Faiz BSMV		
TOPLAM:		

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	336,841.000	371,309.77	851,909.000	938,728.74



FON RİSK RAPORU

29.01.2021

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	92,268,449.22
Fon Toplam Değeri	88,435,859.24
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.71

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

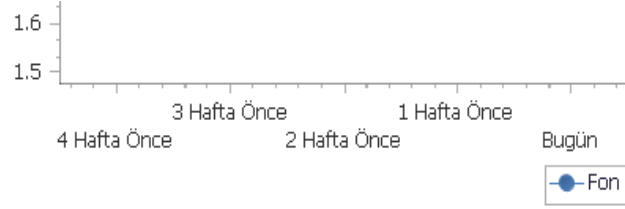
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1,515,958.13			
RMD (%)	1.71			5.59
Beklenen Kayıp	1,741,463.39			
Beklenen Kayıp (%)	1.97			
Uç Değer Adedi	3			

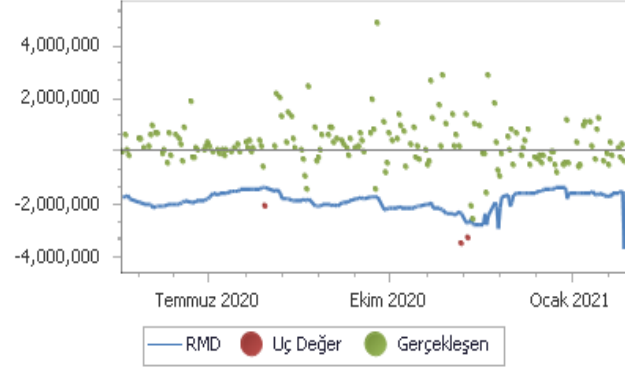
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	10,693,132	106,508	0.12
Takasbank Para Piyasası	53,074	7	0.00
Eurobond	81,522,243	1,405,657	1.59

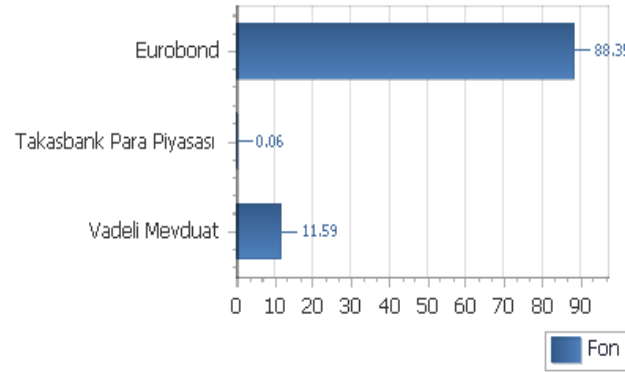
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
---------------------------	--------------------	-----------	---------------



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

