

DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON
Eylül-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-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	129.525.477,00
E-) Katılma Payı Sayısı	:	12.768.919,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	18 Mayıs 2020
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	10,143809
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.142514
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	9,625766
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	1.159130
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	5,38
Aylk Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	-1.43
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	24,93
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	27,28
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	3,71
d-)Özel Sektör Tahvili	:	87,73
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	0,17
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	8,35
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,04
n-)Teminat	:	0,00
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	0,00
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00

G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,04
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00

H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	190,18
------------------------------	---	--------

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	2.507.582,390000

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)	:	3.229.240,550000

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞİM E NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Eurobond Türk																			
XS0847042024	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	24/10/22	388	XS0847042024	3,45	2	390.000,00	105,150000	21/09/21	0,000000				105,157126	3.641.186,42	2,57	2,51	2,81
XS0849728190	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	01/11/22	396	XS0849728190	2,98	2	200.000,00	105,566700	17/09/21	0,000000				104,880946	1.862.370,96	1,31	1,29	1,44
XS1760780731	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/01/23	486	XS1760780731	3,00	2	500.000,00	104,428600	20/09/21	0,000000				103,704035	4.603.681,35	3,25	3,18	3,55
XS1003016018	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	11/12/23	801	XS1003016018	2,39	2	600.000,00	111,205600	20/09/21	0,000000				109,659030	5.841.646,19	4,12	4,03	4,51
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	836	XS1867595750	6,86	2	3.680.000,00	118,569100	07/07/21	0,000000				117,307591	38.327.768,39	27,06	26,47	29,59
XS1970705528	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	28/03/24	909	XS1970705528	8,91	2	645.000,00	100,678500	10/08/21	0,000000				107,716230	6.168.512,64	4,35	4,26	4,76
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24	1140	US900123CW86	4,40	2	600.000,00	100,051200	30/06/21	0,000000				103,673725	5.522.802,99	3,90	3,81	4,26
XS2112797290	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	05/02/25	1223	XS2112797290	5,49	2	200.000,00	101,022900	10/06/21	0,000000				99,656720	1.769.604,38	1,25	1,22	1,37

DZM-DENİZ PORTFÖY BEŞİNCİ SERBEST(DÖVİZ) FON																			
Eylül-2021																			
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
XS2266963003	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	08/01/26	1560	XS2266963003	5,59	2	3.970.000,00	103,805600	29/09/21	0,000000				103,477203	36.473.277,11	25,74	25,18	28,16
XS2281369301	USD	TÜRKİYE SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	14/01/26	1566	XS2281369301	5,74	2	720.000,00	100,760400	25/08/21	0,000000				101,252319	6.472.574,74	4,57	4,47	5,00
XS2274089288	USD	TC ZİRAAT BANKASI	02/03/26	1613	XS2274089288	6,09	2	1.500.000,00	99,405300	03/05/21	0,000000				97,718099	13.013.852,08	9,19	8,98	10,05
XS2332876106	USD	TÜRKİYE İHRACAT KREDİT BANKASI AS	06/07/26	1739	XS2332876106	5,92	2	650.000,00	99,462000	03/09/21	0,000000				99,634954	5.749.958,08	4,06	3,97	4,44
XS1551747733	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	01/11/27	2222	XS1551747733	7,16	2	1.300.000,00	107,075600	14/09/21	0,000000				105,917851	12.225.091,38	8,63	8,44	9,44
GRUP TOPLAMI								14.955.000,00							141.672.326,71	100,00	97,81	109,38	
GRUP TOPLAMI								14.955.000,00							141.672.326,71	100,00	97,81	109,38	
MEVDUAT																			
DENİZBANK A.Ş.	USD		01/10/21	0		0,20		207.311,26		30/09/21				207.312,40	0,200000	1.840.623,14	64,38	1,27	1,42
BURGAN BANK A.Ş.	TL		01/11/21	31		18,15		1.017.931,51		30/09/21				1.034.129,17	18,150000	1.018.433,82	35,62	0,70	0,79
GRUP TOPLAMI								1.225.242,77							2.859.056,96	100,00	1,97	2,21	
GRUP TOPLAMI								1.225.242,77							2.859.056,96	100,00	1,97	2,21	
TPP																			
TPP			01/10/21	0		18,50		225.114,04	18,500000	30/09/21			181739	225.114,04	18,500000	225.114,04	100,00	0,16	0,17
GRUP TOPLAMI								225.114,04							225.114,04	100,00	0,16	0,17	
GRUP TOPLAMI								225.114,04							225.114,04	100,00	0,16	0,17	
TÜREV																			
Forward																			
EUR/USD 1,1827 48377	USD	DENİZBAN K A.Ş.	01/02/22		EUR/USD 1,1827			1.000.000,00	1,182700	13/09/21					1,162535	-179.035,93	-229,78	-0,12	-0,14
EUR/USD 1,1915 48310	USD	DENİZBAN K A.Ş.	01/02/22		EUR/USD 1,1915			-1.000.000,00	1,191500	03/09/21					1,162559	256.952,31	329,78	0,18	0,20
GRUP TOPLAMI								0,00							77.916,38	100,00	0,06	0,06	
GRUP TOPLAMI								0,00							77.916,38	100,00	0,06	0,06	
DİĞER																			
Döviz																			
USD	USD	FED			USD			0,04	8,750000	30/09/21					8,878500	0,36	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								0,04							0,36	0,00	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								0,04							0,36	0,00	0,00	0,00	
FON PORTFÖY DEĞERİ																144.834.414,09		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	144.834.414,09	111,82 %
B-)HAZIR DEĞERLER	9.121,07	0,01 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-15.318.058,16	-11,83 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	129.525.477,00	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	116,59	0,0001 %
Fon Yönetim Ücreti	116.887,60	0,0902 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	505,50	0,0004 %
Kayda Alma Ücreti	1.793,90	0,0014 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	11.679,41	0,0090 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	66,50	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.236,30	0,0010 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	37,89	0,0000 %
	132.323,69	0,1022 %

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
B-Geçen Ay İçinde Yatırım Fonlarına İlişkin Mevzuatta Meydana Gelen Değişme ve Hukuki İhtilaflarla İlgili Açıklamalar				