

DENİZBANK A.Ş. A TİPİ DEĞİŞKEN FON - DZA

28/02/2013 Tarihli Aylık Raporudur.

Şubat 13

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	A TIPI DEGISKEN
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	Deniz Bank A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.
D. FON TUTARI	8,496,114.00
E. FON TOPLAM DEĞERİ	12,087,831.31
F. TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	43,134,000.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	15/01/1998
H. FONUN SÜRESİ:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU PAY FİYATI	0.280239
B. ÖNCEKİ PAY FİYATI:	0.279565
C. AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.24%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-2.62%
E. YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	25.25%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	85.49%
Varant	
Devlet Tahvili	
Özel Sektör Tahvili	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	14.51%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Borsa Para Piyasası	
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Yabancı Hisse Senetleri	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	5.05%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	5.84%
Devlet Borçlanma Senetleri	0.00%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1
J. AYLIK KORELASYON :	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :	

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AEFES	15,000.00	405,000.00	3.34%
AKBNK	127,000.00	1,109,980.00	9.16%
AKENR	15,000.00	25,200.00	0.21%
ALARK	4,000.00	21,600.00	0.18%
ALBRK	30,000.00	55,500.00	0.46%

ANELE	0.30	0.60	0.00%
ARCLK	10,000.00	114,000.00	0.94%
ASYAB	30,000.00	66,300.00	0.55%
BIMAS	7,000.00	596,750.00	4.93%
CCOLA	2,000.00	85,000.00	0.70%
DOHOL	60,000.00	64,800.00	0.54%
EKGYO	50,000.00	146,000.00	1.21%
EREGL	80,000.00	185,600.00	1.53%
GARAN	120,000.00	1,032,000.00	8.52%
HALKB	65,000.00	1,157,000.00	9.55%
ISCTR	110,000.00	706,200.00	5.83%
ISGYO	20,000.66	29,600.98	0.24%
KATMR	0.89	4.34	0.00%
KCHOL	55,312.00	523,251.52	4.32%
KOZAL	2,500.00	106,500.00	0.88%
KRDMD	40,000.00	62,000.00	0.51%
PETKM	30,000.00	93,000.00	0.77%
POLHO	19,999.00	44,197.79	0.36%
SAHOL	83,000.00	813,400.00	6.72%
SISE	55,000.18	161,700.53	1.34%
SNGYO	20,000.00	27,800.00	0.23%
TAVHL	12,000.00	131,400.00	1.08%
TCELL	48,000.00	573,600.00	4.74%
THYAO	63,000.00	469,980.00	3.88%
TKFEN	9,000.00	66,780.00	0.55%
TMSN	6,634.00	24,744.82	0.20%
TTKOM	37,000.00	274,540.00	2.27%
TUPRS	9,000.00	453,600.00	3.75%
VAKBN	50,000.00	276,000.00	2.28%
YKBNK	120,000.00	609,600.00	5.03%
TOPLAM :	1,405,447.03	10,512,630.58	86.80%

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:

E) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)

F) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

G) FİNANSMAN BONOLARI:

H) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

I) YABANCI MENKUL KIYMETLER:

İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER

J) VOB İŞLEMLERİ

L) OPSİYON İŞLEMLERİ

M) VOB TEMİNAT İŞLEMLERİ

K) DİĞER

RRP TRT041213T23	1,500,185.34	1,500,185.34	12.39%
RRP TRT150513T11	99,011.36	99,011.36	0.82%
TOPLAM :	1,599,196.70	1,599,196.70	13.20%

FON PORTFÖY DEĞERİ	3,004,643.73	12,111,827.28		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	12,111,827.28	100.20%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	1,711.04	0.01%		
C. ALACAKLAR (+) :	0.00	0.00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	25,707.01	0.21%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	12,087,831.31			
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	12,478.67			
37002Denetim Ücreti	245.84			
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	250.00			
37004Aracılık Komisyonu	252.17			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	26.25			
37006Saklama Giderleri	22.30			
37012Portföy Yönetim Ücreti	12,478.68			
37097FİG Giderleri	1,727.34			
TOPLAM	27,481.25			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal			
7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal	Satış Değeri
8- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal		
9- PORTFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değeri
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	01/02/13-04/02/13	265,470.00	253,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240914T15	01/02/13-04/02/13	3,450,340.00	3,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT140813T19	04/02/13-05/02/13	28,475.00	43,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT140813T19	04/02/13-05/02/13	1,324,250.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	05/02/13-06/02/13	50,320.00	48,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT230222T13	05/02/13-06/02/13	1,634,010.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	06/02/13-07/02/13	42,980.00	41,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT230222T13	06/02/13-07/02/13	1,636,355.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	07/02/13-08/02/13	1,506,405.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	07/02/13-08/02/13	137,290.00	131,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT041213T23	08/02/13-11/02/13	1,468,450.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	08/02/13-11/02/13	106,915.00	102,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	11/02/13-12/02/13	1,034,935.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	11/02/13-12/02/13	106,845.00	102,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	12/02/13-13/02/13	1,050.00	1,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT230222T13	12/02/13-13/02/13	1,229,995.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT140813T19	13/02/13-14/02/13	1,043,605.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	13/02/13-14/02/13	9,425.00	9,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	14/02/13-15/02/13	758,820.00	1,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	14/02/13-15/02/13	471,175.00	450,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	14/02/13-15/02/13	49,215.00	47,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT041213T23	15/02/13-18/02/13	978,225.00	1,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	15/02/13-18/02/13	518,330.00	495,000.00

Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	18/02/13-19/02/13	1,424,475.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT041213T23	19/02/13-20/02/13	977,410.00	1,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150513T11	19/02/13-20/02/13	521,220.00	494,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT041213T23	20/02/13-21/02/13	1,465,960.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	20/02/13-21/02/13	35,570.00	34,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	21/02/13-22/02/13	52,285.00	50,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT210721T11	21/02/13-22/02/13	1,179,545.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	22/02/13-25/02/13	1,135,395.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	22/02/13-25/02/13	53,340.00	51,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	25/02/13-26/02/13	99,295.00	95,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	25/02/13-26/02/13	1,519,440.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	26/02/13-27/02/13	62,015.00	82,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150513T11	26/02/13-27/02/13	22,125.00	21,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT160714T17	26/02/13-27/02/13	1,529,715.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	27/02/13-28/02/13	1,421,010.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150513T11	27/02/13-28/02/13	105,335.00	100,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT041213T23	28/02/13-01/03/13	1,463,315.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150513T11	28/02/13-01/03/13	104,270.00	99,000.00
TOPLAM :			31,024,600.00	35,248,000.00
Hisse Senedi	HALKB	06/02/2013	16,000.00	284,800.00
Hisse Senedi	YKBNK	06/02/2013	60,000.00	315,600.00
TOPLAM :			76,000.00	600,400.00
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00