

DENİZBANK A.Ş A TİPİ İMKB ULUSAL 100 ENDEKSİ FONU - HİSSE SENEDİ YOĞUN FON - DZE

28/02/2013 Tarihli Aylık Raporudur.

Şubat 13

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	A TİPİ İMKB ULUSAL 100 ENDEKSİ FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	DENİZBANK A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.
D. FON TUTARI	30,000,000.00
E. FON TOPLAM DEĞERİ	8,833,667.07
F. TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	188,614,000.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	04/07/2001
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU PAY FİYATI	0.046835
B. ÖNCEKİ PAY FİYATI:	0.046468
C. AYLİK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.79%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	1.36%
E. YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	34.80%
F. AYLİK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	

Hisse Senedi	95.44%
Varant	
Devlet Tahvili	
Özel Sektör Tahvili	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	4.56%
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. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	5.91%
H. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	21.90%
Devlet Borçlanma Senetleri	0.00
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1.00
J. AYLİK KORELASYON :	0.00
K. ÜÇ AYLİK KORELASYON :	99.81%

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AEFES	10,000.00	270,000.00	3.05%
AKBNK	84,000.00	734,160.00	8.30%
ARCLK	15,000.00	171,000.00	1.93%
ASELS	14,000.95	142,809.69	1.61%
ASYAB	20,000.00	44,200.00	0.50%
AYGAZ	13,000.00	127,920.00	1.45%
BIMAS	4,300.00	366,575.00	4.14%

CCOLA	3,000.00	127,500.00	1.44%
DOHOL	62,000.00	66,960.00	0.76%
EKGYO	38,000.00	110,960.00	1.25%
ENKAI	17,000.71	93,163.89	1.05%
EREGL	76,000.51	176,321.18	1.99%
FROTO	5,800.00	122,960.00	1.39%
GARAN	100,000.00	860,000.00	9.72%
HALKB	42,000.00	747,600.00	8.45%
ISCTR	95,000.00	609,900.00	6.89%
ISGYO	23,000.66	34,040.98	0.38%
KCHOL	32,000.00	302,720.00	3.42%
KOZAA	18,000.00	86,580.00	0.98%
KOZAL	2,800.00	119,280.00	1.35%
KRDMD	22,000.00	34,100.00	0.39%
MGROS	2,300.00	49,910.00	0.56%
PETKM	32,000.00	99,200.00	1.12%
SAHOL	53,000.00	519,400.00	5.87%
SISE	31,000.32	91,140.94	1.03%
TAVHL	15,000.00	164,250.00	1.86%
TCELL	38,000.00	454,100.00	5.13%
THYAO	39,000.00	290,940.00	3.29%
TKFEN	14,000.00	103,880.00	1.17%
TOASO	15,000.00	167,250.00	1.89%
TRKCM	24,000.00	66,000.00	0.75%
TSKB	27,000.06	62,640.14	0.71%
TTKOM	26,000.00	192,920.00	2.18%
TTRAK	700.00	41,300.00	0.47%
TUPRS	7,700.00	388,080.00	4.39%
ULKER	7,200.00	81,720.00	0.92%
VAKBN	46,000.00	253,920.00	2.87%
YKBNK	51,000.00	259,080.00	2.93%
TOPLAM :	1,125,803.21	8,634,481.82	97.59%

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 TRT150513T11	139,015.96	139,015.96	1.57%
RRP TRT200313T16	74,008.37	74,008.37	0.84%
TOPLAM :	213,024.33	213,024.33	2.41%

FON PORTFÖY DEĞERİ	1,338,827.54	8,847,506.15		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	8,847,506.15	100.16%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	1,783.25	0.02%		
C. ALACAKLAR (+) :	0.00	0.00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	15,622.33	0.18%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	8,833,667.07			
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	4,341.97			
37002Denetim Ücreti	482.44			
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	59.70			
37004Aracılık Komisyonu	734.08			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	26.25			
37006Saklama Giderleri	155.13			
37012Portföy Yönetim Ücreti	4,341.70			
370141İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	420.00			
TOPLAM	10,561.27			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM. 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	72,405.00	69,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240914T15	01/02/13-04/02/13	985,815.00	1,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	04/02/13-05/02/13	271,230.00	285,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT140813T19	04/02/13-05/02/13	331,065.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	05/02/13-06/02/13	380,435.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	05/02/13-06/02/13	345,950.00	330,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	06/02/13-07/02/13	365,410.00	384,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	07/02/13-08/02/13	336,675.00	447,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	08/02/13-11/02/13	105,735.00	153,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT230222T13	08/02/13-11/02/13	412,235.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	11/02/13-12/02/13	170,000.00	228,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT260214T10	12/02/13-13/02/13	136,230.00	142,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	13/02/13-14/02/13	129,850.00	124,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	14/02/13-15/02/13	115,040.00	121,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	15/02/13-18/02/13	411,525.00	393,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	15/02/13-18/02/13	20,945.00	20,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	18/02/13-19/02/13	165,345.00	158,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT290415T14	19/02/13-20/02/13	169,590.00	221,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	20/02/13-21/02/13	57,870.00	84,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	20/02/13-21/02/13	232,225.00	222,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	21/02/13-22/02/13	298,025.00	285,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT290114T18	22/02/13-25/02/13	289,145.00	286,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	25/02/13-26/02/13	37,145.00	54,000.00

Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	25/02/13-26/02/13	223,565.00	236,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT040516T11	26/02/13-27/02/13	340,630.00	418,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT040516T11	27/02/13-28/02/13	174,430.00	215,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150513T11	28/02/13-01/03/13	146,400.00	139,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	28/02/13-01/03/13	77,315.00	74,000.00
TOPLAM :			6,802,230.00	7,588,000.00
Hisse Senedi	AEFES	04/02/2013	600.00	15,600.00
Hisse Senedi	AKBNK	04/02/2013	5,000.00	45,900.00
Hisse Senedi	ARCLK	04/02/2013	1,000.00	12,250.00
Hisse Senedi	ASELS	04/02/2013	1,000.00	8,460.00
Hisse Senedi	ASYAB	04/02/2013	1,000.00	2,270.00
Hisse Senedi	AYGAZ	04/02/2013	1,000.00	10,200.00
Hisse Senedi	BIMAS	04/02/2013	200.00	17,700.00
Hisse Senedi	CCOLA	04/02/2013	300.00	12,510.00
Hisse Senedi	DOHOL	04/02/2013	3,000.00	3,390.00
Hisse Senedi	EKGYO	04/02/2013	2,000.00	6,420.00
Hisse Senedi	ENKAI	04/02/2013	1,000.00	5,460.00
Hisse Senedi	EREGL	04/02/2013	4,000.00	9,960.00
Hisse Senedi	FROTO	04/02/2013	400.00	8,160.00
Hisse Senedi	GARAN	04/02/2013	4,000.00	36,400.00
Hisse Senedi	HALKB	04/02/2013	3,000.00	54,600.00
Hisse Senedi	ISCTR	04/02/2013	5,000.00	33,300.00
Hisse Senedi	ISGYO	04/02/2013	1,000.00	1,620.00
Hisse Senedi	KCHOL	04/02/2013	2,000.00	18,800.00
Hisse Senedi	KOZAA	04/02/2013	1,000.00	5,160.00
Hisse Senedi	KOZAL	04/02/2013	200.00	8,920.00
Hisse Senedi	KRDMD	04/02/2013	1,000.00	1,570.00
Hisse Senedi	PETKM	04/02/2013	2,000.00	6,280.00
Hisse Senedi	SAHOL	04/02/2013	3,000.00	30,150.00
Hisse Senedi	SISE	04/02/2013	2,000.00	6,560.00
Hisse Senedi	TAVHL	04/02/2013	1,000.00	10,900.00
Hisse Senedi	TCELL	04/02/2013	2,000.00	21,800.00
Hisse Senedi	THYAO	04/02/2013	2,000.00	13,240.00
Hisse Senedi	TKFEN	04/02/2013	1,000.00	7,340.00
Hisse Senedi	TOASO	04/02/2013	1,000.00	10,750.00
Hisse Senedi	TRKCM	04/02/2013	3,000.00	8,190.00
Hisse Senedi	TSKB	04/02/2013	1,000.00	2,310.00
Hisse Senedi	TTKOM	04/02/2013	1,000.00	7,580.00
Hisse Senedi	TUPRS	04/02/2013	400.00	20,240.00
Hisse Senedi	ULKER	04/02/2013	400.00	4,160.00
Hisse Senedi	VAKBN	04/02/2013	3,000.00	16,500.00
Hisse Senedi	YKBNK	04/02/2013	3,000.00	15,840.00
Hisse Senedi	AEFES	07/02/2013	400.00	10,400.00
Hisse Senedi	AKBNK	07/02/2013	3,000.00	26,640.00
Hisse Senedi	ASELS	07/02/2013	1,000.00	8,600.00
Hisse Senedi	ASYAB	07/02/2013	1,000.00	2,300.00
Hisse Senedi	BIMAS	07/02/2013	500.00	43,750.00
Hisse Senedi	DOHOL	07/02/2013	2,000.00	2,220.00
Hisse Senedi	EKGYO	07/02/2013	3,000.00	9,390.00
Hisse Senedi	ENKAI	07/02/2013	1,000.00	5,300.00
Hisse Senedi	EREGL	07/02/2013	3,000.00	7,440.00
Hisse Senedi	GARAN	07/02/2013	3,000.00	26,220.00
Hisse Senedi	HALKB	07/02/2013	1,000.00	17,450.00
Hisse Senedi	ISCTR	07/02/2013	4,000.00	25,200.00
Hisse Senedi	ISGYO	07/02/2013	4,000.00	6,400.00
Hisse Senedi	KCHOL	07/02/2013	1,000.00	9,340.00
Hisse Senedi	KOZAA	07/02/2013	4,000.00	20,400.00
Hisse Senedi	KOZAL	07/02/2013	100.00	4,340.00
Hisse Senedi	KRDMD	07/02/2013	4,000.00	6,360.00
Hisse Senedi	MGROS	07/02/2013	200.00	4,210.00
Hisse Senedi	PETKM	07/02/2013	2,000.00	6,460.00
Hisse Senedi	SAHOL	07/02/2013	2,000.00	20,300.00

Hisse Senedi	SISE	07/02/2013	3,000.00	9,750.00
Hisse Senedi	TAVHL	07/02/2013	2,000.00	20,900.00
Hisse Senedi	TCELL	07/02/2013	4,000.00	45,000.00
Hisse Senedi	THYAO	07/02/2013	2,000.00	13,560.00
Hisse Senedi	TKFEN	07/02/2013	1,000.00	7,000.00
Hisse Senedi	TRKCM	07/02/2013	2,000.00	5,340.00
Hisse Senedi	TSKB	07/02/2013	2,000.00	4,600.00
Hisse Senedi	TTKOM	07/02/2013	1,000.00	7,300.00
Hisse Senedi	TUPRS	07/02/2013	600.00	30,000.00
Hisse Senedi	ULKER	07/02/2013	600.00	6,210.00
Hisse Senedi	VAKBN	07/02/2013	3,000.00	15,780.00
Hisse Senedi	YKBNK	07/02/2013	3,000.00	15,480.00
Hisse Senedi	AEFES	08/02/2013	1,000.00	26,100.00
Hisse Senedi	AKBNK	08/02/2013	2,000.00	17,600.00
Hisse Senedi	ASELS	08/02/2013	1,000.00	8,520.00
Hisse Senedi	ASYAB	08/02/2013	1,000.00	2,270.00
Hisse Senedi	BIMAS	08/02/2013	100.00	8,675.00
Hisse Senedi	DOHOL	08/02/2013	2,000.00	2,240.00
Hisse Senedi	ENKAI	08/02/2013	1,000.00	5,240.00
Hisse Senedi	EREGL	08/02/2013	3,000.00	7,320.00
Hisse Senedi	FROTO	08/02/2013	200.00	4,080.00
Hisse Senedi	GARAN	08/02/2013	2,000.00	17,400.00
Hisse Senedi	HALKB	08/02/2013	2,000.00	34,900.00
Hisse Senedi	ISCTR	08/02/2013	3,000.00	19,200.00
Hisse Senedi	ISGYO	08/02/2013	1,000.00	1,570.00
Hisse Senedi	KCHOL	08/02/2013	1,000.00	9,140.00
Hisse Senedi	KOZAA	08/02/2013	1,000.00	4,920.00
Hisse Senedi	KOZAL	08/02/2013	100.00	4,320.00
Hisse Senedi	KRDMD	08/02/2013	1,000.00	1,590.00
Hisse Senedi	PETKM	08/02/2013	1,000.00	3,280.00
Hisse Senedi	SAHOL	08/02/2013	1,000.00	10,300.00
Hisse Senedi	SISE	08/02/2013	1,000.00	3,170.00
Hisse Senedi	TAVHL	08/02/2013	1,000.00	10,400.00
Hisse Senedi	TCELL	08/02/2013	2,000.00	22,700.00
Hisse Senedi	THYAO	08/02/2013	2,000.00	13,200.00
Hisse Senedi	TKFEN	08/02/2013	1,000.00	6,940.00
Hisse Senedi	TRKCM	08/02/2013	1,000.00	2,660.00
Hisse Senedi	TSKB	08/02/2013	1,000.00	2,280.00
Hisse Senedi	TUPRS	08/02/2013	500.00	24,550.00
Hisse Senedi	ULKER	08/02/2013	1,000.00	10,200.00
Hisse Senedi	VAKBN	08/02/2013	2,000.00	10,560.00
Hisse Senedi	YKBNK	08/02/2013	2,000.00	10,280.00
Hisse Senedi	AKBNK	14/02/2013	4,000.00	33,920.00
Hisse Senedi	ASELS	14/02/2013	1,000.00	9,080.00
Hisse Senedi	ASYAB	14/02/2013	1,000.00	2,220.00
Hisse Senedi	BIMAS	14/02/2013	200.00	16,650.00
Hisse Senedi	DOHOL	14/02/2013	3,000.00	3,330.00
Hisse Senedi	ENKAI	14/02/2013	1,000.00	5,220.00
Hisse Senedi	EREGL	14/02/2013	3,000.00	7,080.00
Hisse Senedi	FROTO	14/02/2013	200.00	4,080.00
Hisse Senedi	GARAN	14/02/2013	3,000.00	25,680.00
Hisse Senedi	HALKB	14/02/2013	2,000.00	33,500.00
Hisse Senedi	ISCTR	14/02/2013	3,000.00	19,140.00
Hisse Senedi	ISGYO	14/02/2013	1,000.00	1,510.00
Hisse Senedi	KCHOL	14/02/2013	1,000.00	8,920.00
Hisse Senedi	KOZAA	14/02/2013	500.00	2,510.00
Hisse Senedi	KOZAL	14/02/2013	200.00	8,560.00
Hisse Senedi	KRDMD	14/02/2013	1,000.00	1,600.00
Hisse Senedi	MGROS	14/02/2013	100.00	2,085.00
Hisse Senedi	SAHOL	14/02/2013	2,000.00	20,400.00
Hisse Senedi	TAVHL	14/02/2013	500.00	5,150.00
Hisse Senedi	THYAO	14/02/2013	1,000.00	6,660.00

Hisse Senedi	TKFEN	14/02/2013	500.00	3,500.00
Hisse Senedi	TOASO	14/02/2013	500.00	5,350.00
Hisse Senedi	TRKCM	14/02/2013	1,000.00	2,600.00
Hisse Senedi	TSKB	14/02/2013	1,000.00	2,280.00
Hisse Senedi	TTKOM	14/02/2013	1,000.00	7,200.00
Hisse Senedi	VAKBN	14/02/2013	1,000.00	5,280.00
Hisse Senedi	YKBNK	14/02/2013	1,000.00	5,040.00
Hisse Senedi	AKBNK	25/02/2013	2,000.00	17,000.00
Hisse Senedi	ASELS	25/02/2013	1,000.00	10,040.00
Hisse Senedi	ASYAB	25/02/2013	1,000.00	2,090.00
Hisse Senedi	DOHOL	25/02/2013	2,000.00	2,060.00
Hisse Senedi	EKGYO	25/02/2013	1,000.00	2,850.00
Hisse Senedi	ENKAI	25/02/2013	1,000.00	5,280.00
Hisse Senedi	GARAN	25/02/2013	3,000.00	25,140.00
Hisse Senedi	HALKB	25/02/2013	1,000.00	16,500.00
Hisse Senedi	ISCTR	25/02/2013	5,000.00	31,100.00
Hisse Senedi	ISGYO	25/02/2013	1,000.00	1,440.00
Hisse Senedi	KCHOL	25/02/2013	1,000.00	9,080.00
Hisse Senedi	KOZAA	25/02/2013	500.00	2,300.00
Hisse Senedi	PETKM	25/02/2013	1,000.00	3,090.00
Hisse Senedi	SAHOL	25/02/2013	3,000.00	29,100.00
Hisse Senedi	TAVHL	25/02/2013	1,500.00	15,600.00
Hisse Senedi	TCELL	25/02/2013	1,000.00	11,700.00
Hisse Senedi	THYAO	25/02/2013	2,000.00	13,800.00
Hisse Senedi	TKFEN	25/02/2013	500.00	3,510.00
Hisse Senedi	TOASO	25/02/2013	500.00	5,675.00
Hisse Senedi	TSKB	25/02/2013	1,000.00	2,260.00
Hisse Senedi	TTKOM	25/02/2013	1,000.00	7,220.00
Hisse Senedi	TUPRS	25/02/2013	200.00	10,100.00
Hisse Senedi	ULKER	25/02/2013	200.00	2,320.00
Hisse Senedi	VAKBN	25/02/2013	2,000.00	10,520.00
Hisse Senedi	YKBNK	25/02/2013	2,000.00	9,760.00
TOPLAM :			236,900.00	1,747,815.00
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00