

DENİZBANK A.Ş. B TİPİ DEĞİŞKEN BİRİKİM YATIRIM FONU - DZF**28/02/2013 Tarihli Aylık Raporudur.****Şubat 13****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI:	B TİPİ DEĞİSKEN BİRİKİM YATIRIM FONU
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	DENİZBANK A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.
D. FON TUTARI	2,000,000.00
E. FON TOPLAM DEĞERİ	13,583,090.60
F. TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	19,495,000.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	15/01/1998
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU PAY FİYATI	0.696747
B. ÖNCEKİ PAY FİYATI:	0.691019
C. AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.83%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	2.07%
E. YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	20.29%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	16.10%
Varant	
Devlet Tahvili	76.09%
Özel Sektör Tahvili	5.27%
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	2.54%
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:	9.18%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	13.65%
Devlet Borçlanma Senetleri	86.54%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,046.1890
J. AYLIK KORELASYON :	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :	

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
ARCLK	15,000.00	171,000.00	1.26%
ASYAB	60,000.00	132,600.00	0.98%
BRISA	50,000.00	270,000.00	1.99%
HALKB	20,000.00	356,000.00	2.62%
KATMR	53,104.80	259,151.42	1.91%
KOZAA	40,000.00	192,400.00	1.42%
NETAS	10,000.00	104,000.00	0.76%
PETKM	120,000.00	372,000.00	2.74%
PNSUT	7,000.00	107,100.00	0.79%
VAKBN	50,000.00	276,000.00	2.03%
TOPLAM :	425,104.80	2,240,251.42	16.48%

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT070115T13	3,100,000.00	3,176,277.39	23.36%
TRT140218T10	4,000,000.00	4,030,071.56	29.64%
TRT240914T15	3,000,000.00	3,182,190.30	23.40%
TOPLAM :	10,100,000.00	10,388,539.25	76.40%
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
E) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
F) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
G) FİNANSMAN BONOLARI:			
H) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSDZBK51513	300,000.00	302,501.90	2.22%
TRSFBAH31410	160,000.00	164,681.65	1.21%
TRSLYEU21515	395,958.00	396,663.87	2.92%
TRSSKBK61314	100,000.00	98,288.43	0.72%
TOPLAM :	955,958.00	962,135.85	7.08%
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
i) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
J) VOB İŞLEMLERİ			
L) OPSİYON İŞLEMLERİ			
M) VOB TEMİNAT İŞLEMLERİ			
K) DİĞER			
RRP TRT200313T16	6,000.69	6,000.69	0.04%
TOPLAM :	6,000.69	6,000.69	0.04%
FON PORTFÖY DEĞERİ	11,487,063.49	13,596,927.22	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	13,596,927.22	100.10%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	1,077.80	0.01%	
C. ALACAKLAR (+) :	0.00	0.00%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :	14,914.41	0.11%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	13,583,090.60		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	7,049.94		
37002Denetim Ücreti	229.32		
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	80.40		
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	44.78		
37004Aracılık Komisyonu	117.18		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	26.25		
37006Saklama Giderleri	89.93		
37012Portföy Yönetim Ücreti	7,049.76		
TOPLAM	14,687.56		
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
Devlet Tahvili	TRT070115T13	04/02/2013	500,000.00	508,846.43
Devlet Tahvili	TRT070115T13	21/02/2013	500,000.00	511,839.29
Devlet Tahvili	TRT240914T15	26/02/2013	200,000.00	211,924.95
Devlet Tahvili	TRT070115T13	28/02/2013	1,500,000.00	1,536,417.86
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	TRT070115T13	01/02/2013	1,000,000.00	1,017,457.14
Devlet Tahvili	TRT070115T13	04/02/2013	500,000.00	508,971.43
Devlet Tahvili	TRT070115T13	07/02/2013	400,000.00	408,191.43
Devlet Tahvili	TRT140218T10	19/02/2013	1,000,000.00	1,006,500.00
Devlet Tahvili	TRT140218T10	19/02/2013	1,000,000.00	1,006,500.00
Devlet Tahvili	TRT140218T10	19/02/2013	2,000,000.00	2,011,000.00
TOPLAM :			5,900,000.00	5,958,620.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	01/02/13-04/02/13	7,350.00	7,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	04/02/13-05/02/13	71,300.00	68,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	05/02/13-06/02/13	191,370.00	201,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	06/02/13-07/02/13	9,435.00	9,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	06/02/13-07/02/13	419,295.00	400,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	06/02/13-07/02/13	62,895.00	60,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	07/02/13-08/02/13	50,305.00	48,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200213T25	08/02/13-11/02/13	123,180.00	118,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	08/02/13-11/02/13	144,650.00	138,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	11/02/13-12/02/13	194,830.00	186,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	11/02/13-12/02/13	115,225.00	110,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	12/02/13-13/02/13	290,100.00	277,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	13/02/13-14/02/13	230,375.00	220,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	13/02/13-14/02/13	37,700.00	36,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	14/02/13-15/02/13	260,495.00	274,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150513T11	15/02/13-18/02/13	367,470.00	348,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	18/02/13-19/02/13	140,230.00	134,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT040614T12	19/02/13-20/02/13	4,016,460.00	4,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT110913T11	19/02/13-20/02/13	358,845.00	334,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	20/02/13-21/02/13	278,255.00	266,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	20/02/13-21/02/13	56,490.00	54,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	21/02/13-22/02/13	149,535.00	143,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	22/02/13-25/02/13	146,415.00	140,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050314T14	25/02/13-26/02/13	143,045.00	151,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	25/02/13-26/02/13	5,230.00	5,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT011014T19	26/02/13-27/02/13	32,135.00	45,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150513T11	27/02/13-28/02/13	42,135.00	40,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200313T16	28/02/13-01/03/13	6,270.00	6,000.00
TOPLAM :			7,951,020.00	7,818,000.00
Hisse Senedi	BRISA	19/02/2013	50,000.00	279,000.00
TOPLAM :			50,000.00	279,000.00
Özel SektÖr Tahvili	TRSLYEU21515	21/02/2013	395,958.00	395,958.00
TOPLAM :			395,958.00	395,958.00
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:				
Verilen Ödünçler	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
TOPLAM :			0.00	0.00
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0.00	0.00