

DPB-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON

Mart 2018

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DPB-DENİZ PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	2,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	200,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	23,079,810.36
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	22,055,315.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.046451
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.016741
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	2.92
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	2.62
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	93.37
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) BPP	:	6.01
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.60
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.02
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	8.724
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.03
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	1,566.54

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
---------	------	---------------	--------------	-------

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1003016018	10/11/23	200,000.00	848,651.19	3.67
XS1175854923	03/03/25	2,600,000.00	10,415,376.43	45.09
XS1584113184	29/03/27	600,000.00	2,381,994.78	10.31
XS1623796072	29/06/28	1,700,000.00	6,746,837.37	29.21
US900123BG46	30/05/40	230,000.00	949,023.51	4.11
TOPLAM:		5,330,000.00	21,341,883.28	92.39

MEVDUAT

Mevduat	02/04/18	355,442.16	1,403,778.59	6.08
TOPLAM:		355,442.16	1,403,778.59	6.08

BPP

BPP	02/04/18	352,442.65	352,442.65	1.53
TOPLAM:		352,442.65	352,442.65	1.53

PORTFÖY DEĞERİ:	6,037,884.81	23,098,104.52	100.00
-----------------	--------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	23,098,104.52	100.08 %
B-)HAZIR DEĞERLER	2,029.72	0.01 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-20,323.88	-0.09 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	23,079,810.36	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	554.76	0.0024 %

Fon Yönetim Ücreti	15,919.98	0.0690 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	254.40	0.0011 %
Kayda Alma Ücreti	1,153.99	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2,212.54	0.0096 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	40.38	0.0002 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	749.54	0.0032 %
Diğer Harcamalar	69.63	0.0003 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	117.12	0.0005 %
TOPLAM:	21,072.34	0.0913 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA Sirketin Unvaniİşlem TipiBDL-BDZ TarihiNominal DeğeriTUTAR				
VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ				
Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	0.000	0.00	11,804,403.000	12,157,046.61

DPB - Deniz Portföy Birinci Serbest Fon-30.03.2018 Risk Bildirim Tablosu				
Fon Portföy Değeri	23,098,104.52			
Fon Toplam Değeri	23,079,810.36			
Risk Değeri	6			
Fon Portföyü Standart Sapması	0.54			
Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi				
Açık Pozisyon Tutarı				
Kaldıraç Oranı		Limit : 5.00		
RMD Özeti				
	Fon			Limit
RMD	273,315.84			
RMD (%)	1.18			5.59
Beklenen Kayıp	365,837.49			
Beklenen Kayıp (%)	1.59			
Uç Değer Adedi	1			
RMD Kırılımı				
Piyasa	Büüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)	
Takasbank Para Piyasası	352,443	-117	0.00	
Vadeli Mevduat	1,403,779	2,138	0.01	
Eurobond	21,341,883	255,449	1.11	
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)	