

DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) FON**E-2020****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DPB-DENİZ PORTFÖY SERBEST(DÖVİZ) 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	:	2,000,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	931,292,128.48
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	423,887,554.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	23 Ekim 2015
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	2.197026
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	2.092958
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	4.97
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	23.77
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	40.23
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	99.83
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) TPP	:	0.03
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.14
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	21.799
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	864.58

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
XS1867595750	15/01/24	20,211,000.00	170,522,141.77	17.85
XS2112797290	05/02/25	2,610,000.00	18,424,187.22	1.93
XS1584113184	29/03/27	15,720,000.00	113,651,209.61	11.90
XS1551747733	01/11/27	16,508,000.00	124,297,356.78	13.01
XS1623796072	29/06/28	10,224,000.00	73,212,234.83	7.66
XS2106022754	22/01/30	36,321,000.00	264,111,736.65	27.65

US900123BB58	05/03/38	1,200,000.00	9,082,473.32	0.95
US900123CG37	17/02/45	16,000,000.00	109,305,727.91	11.44
US900123CM05	13/05/47	10,820,000.00	68,264,113.08	7.15
	TOPLAM:	129,614,000.00	950,871,181.17	99.54

MEVDUAT

Mevduat	01/10/20	534,197.51	4,141,228.57	0.43
	TOPLAM:	534,197.51	4,141,228.57	0.43

TPP

TPP	01/10/20	234,080.46	234,080.46	0.03
	TOPLAM:	234,080.46	234,080.46	0.03

PORTFÖY DEĞERİ: 130,382,277.97 955,246,490.20 100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	955,246,490.20	102.57 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,894.92	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-873,272.58	-0.09 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	-23,084,984.06	-2.48 %
FON TOPLAM DEĞERİ	931,292,128.48	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	134.13	0.0000 %
Fon Yönetim Ücreti	770,721.48	0.0828 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	261.90	0.0000 %
Kayda Alma Ücreti	15,374.75	0.0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	62,547.96	0.0067 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	8,038,337.88	0.8631 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	784.35	0.0001 %
BİST KYD Ücreti	523.80	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	22.92	0.0000 %
TOPLAM:	8,888,709.17	0.9545 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE SENEDİ ALIM, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
USD	28,328,158.000	8,090,332.06	6,500,215.000	1,861,426.83



FON RİSK RAPORU

30.09.2020

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

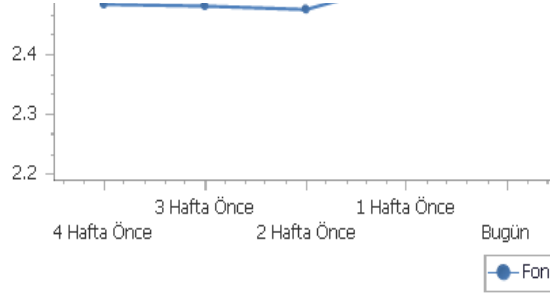
Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	955,246,490.20
Fon Toplam Değeri	931,292,128.48

Fon RMD Trendi



Risk Deęeri	7
Fon Portföyü Standart Sapması	0.65



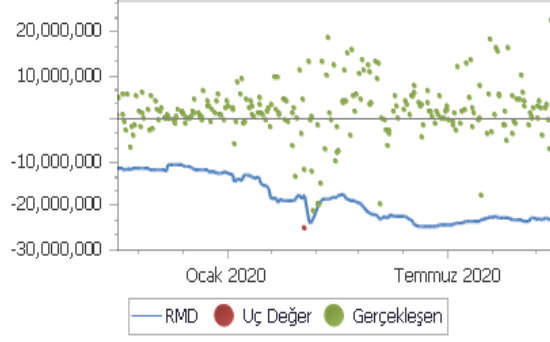
Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelİ	Limit
RMD	23,595,982.07			
RMD (%)	2.53			5.59
Beklenen Kayıp	23,764,613.05			
Beklenen Kayıp (%)	2.55			
Uç Deęer Adedi	1			

Geriye Dönük Test

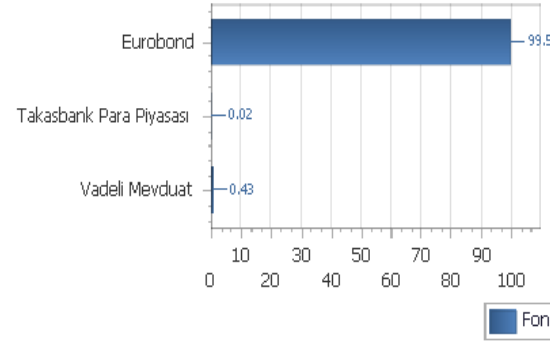


RMD Kırılımı

Piyasa	BüyükLük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	4,141,229	-18,861	0.00
Takasbank Para Piyasası	234,080	-70	0.00
Eurobond	950,871,181	23,526,590	2.53

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme BüyükLüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)

Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

