

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	B TİPİ DENİZBANK LÜKS ENDEKSİNİN YÜK ÖNG 18 ALT FONU
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	DENİZBANK A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	DENİZ PORTFÖY A.Ş.
D. FON TUTARI	500,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	14,230,902.49
F. KATILMA PAYI SAYISI:	1,423,300,000.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	23.10.2013
H. FONUN SÜRESİ:	21.11.2013

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	0.009999
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.009934
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.65%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.54%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.04%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	
Varant	
Devlet Tahvili	99.36%
Özel Sektör Tahvili	
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	0.64%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	
Yabancı Sabit Getiriliiler	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon İşlemleri	0.01%
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.03%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	2.80%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	18.895
J. AYLIK KORELASYON :	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :	
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	0
M. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	385,439.20

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT191114T18	14,200,000.00	14,149,161.87	99.35%
TOPLAM :	14,200,000.00	14,149,161.87	99.35%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			

N) KATILMA BELGELERİ:			
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
LÜKS ENDEKSİ 18	18,622,000.00	0	0.00%
TOPLAM :	18,622,000.00	0	0.00%

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
RRP TRT251017T18	93,054.42	93,054.42	0.65%
TOPLAM :	93,054.42	93,054.42	0.65%

FON PORTFÖY DEĞERİ 32,915,054.42 14,242,216.29

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:		
	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	14,242,216.29	100.08%
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	1,590.11	0.01%
C. ALACAKLAR (+) :	0	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%
E. BORÇLAR (-) :	12,903.91	0.09%
FON TOPLAM DEĞERİ:	14,230,902.49	31.10.2014

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	
Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	12,903.91
37005Vergi, Resim ve Harçlar	54.4
37006Saklama Giderleri	142.96
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	-0.01
TOPLAM	13,101.26

6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama Nominal

7- PORFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal	Satış Değeri
Devlet Tahvili	TRT191114T18	08.10.2014	400,000.00	396,284.00
TOPLAM :			400,000.00	396,284.00
Opsiyon	LÜKS ENDEKSİ 18	02.10.2014	508,000.00	254
TOPLAM :			508,000.00	254

8- İTFALAR		
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal

9- PORFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değeri
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	01/10/14-02/10/14	73,090.00	69,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	01/10/14-02/10/14	8,475.00	8,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	02/10/14-03/10/14	81,155.00	81,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT290415T14	03/10/14-08/10/14	59,295.00	80,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	08/10/14-09/10/14	101,325.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	09/10/14-10/10/14	101,575.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	10/10/14-13/10/14	91,675.00	92,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	13/10/14-14/10/14	98,840.00	92,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT110215T16	14/10/14-15/10/14	65,950.00	92,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240724T15	15/10/14-16/10/14	93,130.00	92,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	16/10/14-17/10/14	98,505.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200324T13	17/10/14-20/10/14	89,070.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	20/10/14-21/10/14	77,320.00	78,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	20/10/14-21/10/14	14,870.00	15,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	21/10/14-22/10/14	91,695.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT290415T14	22/10/14-23/10/14	68,280.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270116T18	23/10/14-24/10/14	97,000.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	24/10/14-27/10/14	92,080.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	27/10/14-28/10/14	24,910.00	24,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT270923T11	27/10/14-28/10/14	70,575.00	68,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT040117T14	28/10/14-30/10/14	97,275.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	30/10/14-31/10/14	96,615.00	93,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT251017T18	31/10/14-03/11/14	96,405.00	93,000.00
TOPLAM :			1,789,110.00	1,814,000.00

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:				
Verilen Ödünçler	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
TOPLAM :				0
Alınan Ödünçler				0
TOPLAM :				0