

DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST FON

A-2019

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	2,000,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	2,000,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	217,735,419.81
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	198,711,244.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	03 Temmuz 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.095738
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.086380
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.86
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0.82
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	69.81
e-)Devlet Tahvili Repo	:	15.62
f-) TPP	:	0.04
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	13.15
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	1.38
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	8.386
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	:	53.41

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFNURL22028	13/02/20	10,000,000.00	9,828,822.19	4.51
TRSAKYB72013	01/07/20	1,400,000.00	1,283,563.90	0.59
TOPLAM:		11,400,000.00	11,112,386.09	5.10

T.REPO

TRT111120T18	02/01/20	1,438,350.00	1,500,924.66	0.69
TOPLAM:		1,438,350.00	1,500,924.66	0.69

MEVDUAT

Mevduat	02/01/20	25,000,000.00	25,043,131.04	11.49
Mevduat	03/03/20	15,000,000.00	99,937,541.13	45.86
Mevduat	03/03/20	4,000,000.00	26,649,828.44	12.23
Mevduat	03/03/20	15,000,000.00	15,024,947.62	6.90
Mevduat	03/03/20	6,000,000.00	39,974,195.99	18.34
TOPLAM:		65,000,000.00	206,629,644.22	94.82

TPP

TPP	02/01/20	245,144.32	245,144.32	0.11
TOPLAM:		245,144.32	245,144.32	0.11

TÜREV

EUR/TRY 6,7286 43089	03/03/20	-4,000,000.00	-263,602.00	-0.12
EUR/TRY 6,7286 43090	03/03/20	-1,885.00	-146.84	0.00
EUR/TRY 6,7306 43072	03/03/20	-15,000,000.00	-958,507.50	-0.44
EUR/TRY 6,7306 43084	03/03/20	-7,174.00	-544.51	0.00
EUR/TRY 6,7367 43103	03/03/20	-6,000,000.00	-346,803.00	-0.16
EUR/TRY 6,7367 43104	03/03/20	-2,746.46	-191.70	0.00
TOPLAM:		-25,011,805.46	-1,569,795.55	-0.72
PORTFÖY DEĞERİ:		53,071,688.86	217,918,303.74	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	217,918,303.74	100.08 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1,813.56	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-184,697.49	-0.08 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	217,735,419.81	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	4,504.03	0.0021 %
Ödenen Komisyonlar		
Fon Yönetim Ücreti	156,744.29	0.0720 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve	525.30	0.0002 %
İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	10,886.77	0.0050 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri	13,675.00	0.0063 %
İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	52.24	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen	873.52	0.0004 %
Denetim Ücreti		
Otomatik BPP Faiz BSMV	14.30	0.0000 %
TOPLAM:	187,275.45	0.0860 %

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
TL	62,887.000	68,764.61	40,158,642.000	43,911,989.16

DDC - Deniz Portföy Dördüncü Serbest Fon-31.12.2019 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	217,918,303.74
Fon Toplam Değeri	217,735,419.81
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.02

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	126,353.85			
RMD (%)	0.06			5.59
Beklenen Kayıp	145,149.53			
Beklenen Kayıp (%)	0.07			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyükölük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	206,629,644	-1,688,064	-0.78
Takasbank Para Piyasası	245,144	204	0.00
Forward	152,271	-1,825,931	-0.84
Ters Repo	1,500,925	1,233	0.00
Bono	11,112,386	58,960	0.03
Nakit	-1,722,066	0	0.00

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-166,631,149	-1,825,931	-0.84
EUR/TRY 6,7286 43089	-26,648,400	-214,168	-0.10
EUR/TRY 6,7286 43090	-12,558	-5	0.00
EUR/TRY 6,7306 43072	-99,931,500	-1,052,438	-0.48
EUR/TRY 6,7306 43084	-47,794	-20	0.00
EUR/TRY 6,7367 43103	-39,972,600	-362,311	-0.17
EUR/TRY 6,7367 43104	-18,297	-7	0.00