

DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST FON**T-2020****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	:	242,981,472.28
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	208,867,579.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	03 Temmuz 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.163328
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.153333
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.87
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6.17
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	14.37
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	89.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	3.62
f-) TPP	:	0.12
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	7.26
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	8.282
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	:	105.18

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFNURL82022	12/08/20	5,000,000.00	4,987,886.90	2.05
TRFNURL82030	19/08/20	5,000,000.00	4,979,196.96	2.05
TRFDZYO82014	28/08/20	25,500,000.00	25,321,965.14	10.42
TRFNURL92013	02/09/20	5,000,000.00	4,969,852.91	2.04
TRFNURL92021	11/09/20	5,000,000.00	4,957,295.06	2.04
TRFDNFK92016	18/09/20	4,200,000.00	4,143,857.36	1.71
TRFDZBK92043	25/09/20	5,360,000.00	5,294,252.26	2.18
TRFISFA92015	25/09/20	2,020,000.00	1,994,247.32	0.82

TRFHLEKE2012	01/10/20	5,000,000.00	4,930,740.59	2.03
TRFAKBA2026	04/12/20	20,000,000.00	19,441,208.92	8.00
TRFDZBK22115	12/02/21	11,000,000.00	10,475,046.32	4.31
TRFDZBK32122	19/03/21	15,300,000.00	15,352,979.68	6.32
TRSDZBK12218	21/01/22	4,500,000.00	3,889,805.66	1.60
TRSDZBK12226	21/01/22	26,200,000.00	22,673,750.03	9.33
TRSDZBK72121	14/07/21	30,000,000.00	30,053,027.20	12.36
TRSDZBK2110	12/11/21	35,000,000.00	35,124,292.65	14.43
TOPLAM:		204,080,000.00	198,589,404.96	81.69

T.REPO

TRT020322T17	04/08/20	12,776,880.00	13,019,767.12	5.36
TRT170822T15	04/08/20	19,801,900.00	20,030,410.96	8.24
TOPLAM:		32,578,780.00	33,050,178.08	13.60

MEVDUAT

Mevduat	05/08/20	4,200,000.00	4,290,874.15	1.76
TOPLAM:		4,200,000.00	4,290,874.15	1.76

TPP

TPP	04/08/20	115,131.54	115,131.54	0.05
TOPLAM:		115,131.54	115,131.54	0.05

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRDZKVK82018	12/08/20	1,800,000.00	1,840,196.33	0.76
TRDABVK92027	24/09/20	500,000.00	492,978.09	0.20
TRDHVKA2017	06/10/20	500,000.00	510,277.22	0.21
TRDABVKA2017	23/12/20	500,000.00	479,730.06	0.20
TRDABVK32122	23/03/21	4,000,000.00	3,724,693.85	1.53
TOPLAM:		7,300,000.00	7,047,875.55	2.90
PORTFÖY DEĞERİ:		248,273,911.54	243,093,464.28	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	243,093,464.28	100.05 %
B-)HAZIR DEĞERLER	2,007.28	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-113,999.28	-0.05 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	242,981,472.28	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1,845.04	0.0008 %
Fon Yönetim Ücreti	91,445.52	0.0376 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	296.82	0.0001 %
Kayda Alma Ücreti	3,245.71	0.0013 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	14,128.35	0.0058 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	62.10	0.0000 %
Ödemeleri:		

Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	892.59	0.0004 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	94.38	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	672.86	0.0003 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	15.70	0.0000 %
TOPLAM:	112,699.07	0.0463 %

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	6,956,553.000	8,063,522.00	79,412,640.000	92,015,771.94



FON RİSK RAPORU

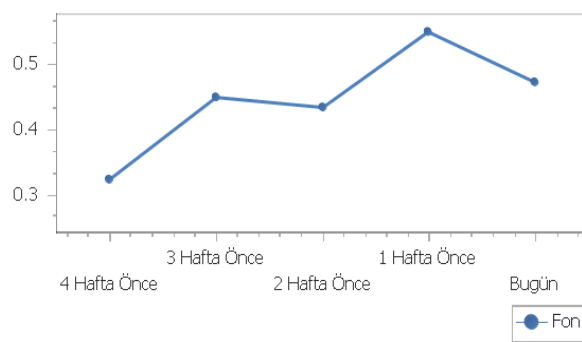
30.07.2020

DDC - Deniz Portföy Dördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	243,093,464.28
Fon Toplam Değeri	242,981,472.28
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.20

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

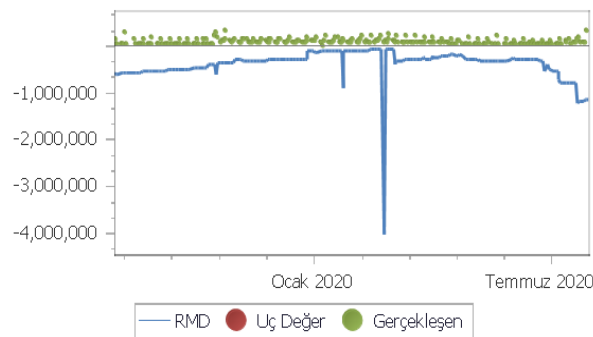
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1,142,229.95			
RMD (%)	0.47			5.59
Beklenen Kayıp	1,312,141.54			
Beklenen Kayıp (%)	0.54			
Uç Değer Adedi	0			

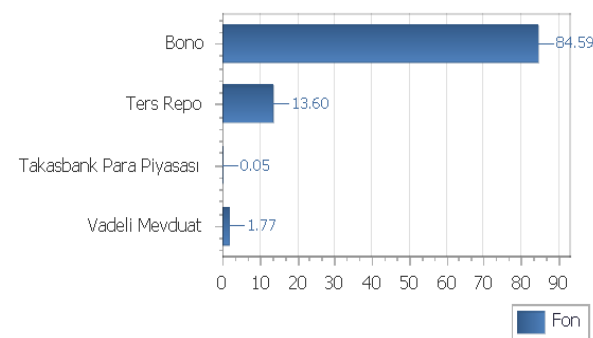
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	4,290,874	-131	0.00
Takasbank Para Piyasası	115,132	-3	0.00
Ters Repo	33,050,178	-1,363	0.00
Bono	205,637,281	1,103,891	0.45
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)

Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

