

**DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST FON****E-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      | : | 17,105,437.26                          |
| G-)Tedavüldeki Pay Sayısı | : | 15,077,659.000                         |
| H-)Fonun Kuruluş Tarihi   | : | 03 Temmuz 2019                         |
| I-)Fonun Süresi           | : | Süresizdir.                            |

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

|                                      |   |          |
|--------------------------------------|---|----------|
| A-)Ay Sonu Pay Fiyatı                | : | 1.134489 |
| B-)Önceki Ay Pay Fiyatı              | : | 1.140531 |
| C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı      | : | -0.53    |
| D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı  | : | 3.54     |
| E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı     | : | 5.56     |
| F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi    | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 0.00     |
| b-)Hazine Bonosu                     | : | 0.00     |
| c-)Devlet Tahvili                    | : | 0.00     |
| d-) Özel Sektör Tahvili              | : | 90.82    |
| e-)Devlet Tahvili Repo               | : | 8.56     |
| f-) TPP                              | : | 0.62     |
| g-) Opsiyon                          | : | 0.00     |
| h-) Varant                           | : | 0.00     |
| i-)Değerli Maden                     | : | 0.00     |
| j-) Mevduat                          | : | 0.00     |
| k-) Katılım Hesabı                   | : | 0.00     |
| l-)Diğer                             | : | 0.00     |
| G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı      | : | 1.230    |
| 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         | : | 31.74    |

**III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU**

| MK KODU                    | VADE     | NOMİNAL DEĞER | RAYİÇ DEĞERİ  | ORAN% |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|-------|
| <b>BORÇLANMA SENETLERİ</b> |          |               |               |       |
| <b>Özel Sektör</b>         |          |               |               |       |
| TRFAKBKA2026               | 04/12/20 | 12,840,000.00 | 12,698,615.89 | 74.15 |
|                            | TOPLAM:  | 12,840,000.00 | 12,698,615.89 | 74.15 |
| <b>TPP</b>                 |          |               |               |       |
| TPP                        | 02/11/20 | 102,118.63    | 102,118.63    | 0.60  |
|                            | TOPLAM:  | 102,118.63    | 102,118.63    | 0.60  |
| <b>BORÇLANMA SENETLERİ</b> |          |               |               |       |
| <b>Özel Sektör</b>         |          |               |               |       |

|                 |          |               |               |        |
|-----------------|----------|---------------|---------------|--------|
| TRDABVKA2017    | 23/12/20 | 500,000.00    | 492,571.30    | 2.88   |
| TRDABVK32122    | 23/03/21 | 4,000,000.00  | 3,829,627.97  | 22.37  |
|                 | TOPLAM:  | 4,500,000.00  | 4,322,199.27  | 25.25  |
| PORTFÖY DEĞERİ: |          | 17,442,118.63 | 17,122,933.79 | 100.00 |

#### IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

| AÇIKLAMA              | TUTAR         | ORAN%    |
|-----------------------|---------------|----------|
| A-)FON PORTFÖY DEĞERİ | 17,122,933.79 | 100.10 % |
| B-)HAZIR DEĞERLER     | 5,163.01      | 0.03 %   |
| C-)ALACAKLAR          | 0.00          | 0.00 %   |
| D-)DİĞER VARLIKLAR    | 0.00          | 0.00 %   |
| E-)BORÇLAR            | -22,659.54    | -0.13 %  |
| F-)İHTİYAT            | 0.00          | 0.00 %   |
| G-)VERGİ              | 0.00          | 0.00 %   |
| FON TOPLAM DEĞERİ     | 17,105,437.26 | 100,00 % |

#### V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| AÇIKLAMA                           | TUTAR     | ORAN%    |
|------------------------------------|-----------|----------|
| Fon Yönetim Ücreti                 | 12,010.19 | 0.0702 % |
| Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu   | 279.36    | 0.0016 % |
| Tescil ve İlan Giderleri           | 490.96    | 0.0029 % |
| Kayda Alma Ücreti                  | 6,128.30  | 0.0358 % |
| Portföydeki Varlıkların Saklanması | 731.58    | 0.0043 % |
| Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler    | 59.37     | 0.0003 % |
| Portföye Alımlarda ve portföyden   | 59.37     | 0.0003 % |
| Satımlarda Ödenen Komisyonlar      | 750.40    | 0.0044 % |
| Fonun Mükellefi Olduğu Vergi       | -0.02     | 0.0000 % |
| Bağımsız Denetim Kuruluşlarına     | 633.28    | 0.0037 % |
| Ödenen Denetim Ücreti              | 19.28     | 0.0001 % |
| Diğer Harcamalar                   | 21,102.70 | 0.1233 % |
| BİST KYD Ücreti                    |           |          |
| Otomatik BPP Faiz BSMV             |           |          |
| TOPLAM:                            |           |          |

#### 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          | 23,096,559.000 | 26,171,206.80 | 0.000         | 0.00         |

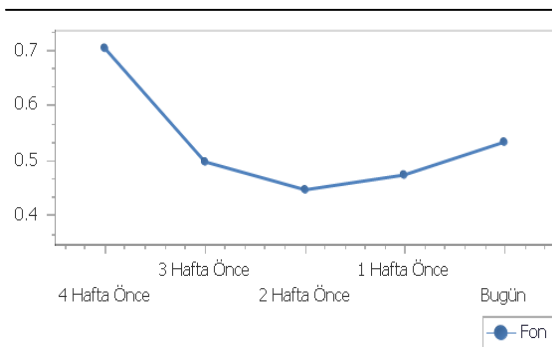
**Deniz** FON RİSK RAPORU 30.10.2020

DDC - Deniz Portföy Dördüncü Serbest Fon

##### Fon Bilgileri

|                               |               |
|-------------------------------|---------------|
| Fon Portföy Değeri            | 17,122,933.79 |
| Fon Toplam Değeri             | 17,105,437.26 |
| Risk Değeri                   | 2             |
| Fon Portföyü Standart Sapması | 0.23          |

##### Fon RMD Trendi



##### Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| Açık Pozisyon Tutarı | Limit : 1.00 |
| Kaldıraç Oranı       | Limit : 5.00 |

##### RMD Özeti

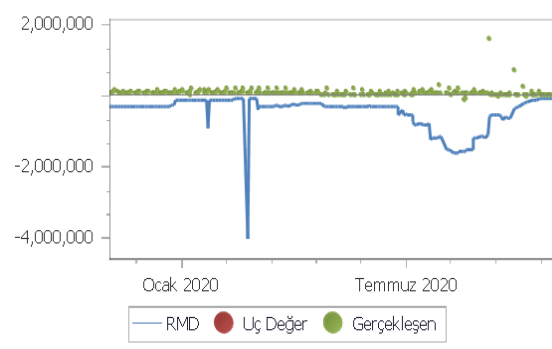
##### Geriye Dönük Test

|                    | Fon        | Kıstas | Görelî | Lîmit |
|--------------------|------------|--------|--------|-------|
| RMD                | 91,219.20  |        |        |       |
| RMD (%)            | 0.53       |        |        | 5.59  |
| Beklenen Kayıp     | 104,788.45 |        |        |       |
| Beklenen Kayıp (%) | 0.61       |        |        |       |
| Uç Değer Adedi     | 0          |        |        |       |

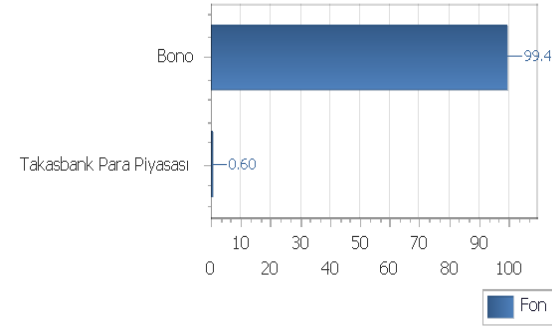
#### RMD Kırılımı

| Piyasa                  | Büyüklik   | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|-------------------------|------------|-----------|---------------|
| Takasbank Para Piyasası | 102,119    | 16        | 0.00          |
| Bono                    | 17,020,815 | 91,094    | 0.53          |

| Kaldıraç Yaratan İşlemler | Sözleşme Büyüklüğü | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|---------------------------|--------------------|-----------|---------------|
|---------------------------|--------------------|-----------|---------------|



#### Fon Varlık Kırılımı



#### Stress Testi

