

DDA-DENİZ PORTFÖY ALTINCI SERBEST FON**E-2020****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DDA-DENİZ PORTFÖY ALTINCI SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	1,000,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	1,000,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	23,122,868.95
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	22,814,217.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	08 Ekim 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.013529
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.013529
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.00
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.17
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	65.87
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	2.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	28.09
f-) TPP	:	3.84
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.17
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.03
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	2.281
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.07
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.22
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	72.00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
AKBNK		789,000.00	3,763,530.00	16.30
AKBNK		30,000.00	143,100.00	0.62
GARAN		584,000.00	3,854,400.00	16.69
GARAN		22,000.00	145,200.00	0.63
HALKB		160,000.00	752,000.00	3.26
ISCTR		428,000.00	2,187,080.00	9.47
ISCTR		29,000.00	148,190.00	0.64
VAKBN		200,000.00	762,000.00	3.30
YKBNK		804,000.00	1,728,600.00	7.49

YKBNK		70,000.00	150,500.00	0.65
TOPLAM:		3,116,000.00	13,634,600.00	59.05

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	1,000,000.00	9,080,399.82	39.31
TOPLAM:		1,000,000.00	9,080,399.82	39.31

MEVDUAT

Mevduat	02/11/20	5,845.07	48,562.84	0.21
TOPLAM:		5,845.07	48,562.84	0.21

TPP

TPP	02/11/20	330,383.79	330,383.79	1.43
TOPLAM:		330,383.79	330,383.79	1.43

PORTFÖY DEĞERİ:		4,452,228.86	23,093,946.45	100.00
-----------------	--	--------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	23,093,946.45	99.87 %
B-)HAZIR DEĞERLER	10,811.34	0.05 %
C-)ALACAKLAR	640,000.00	2.77 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-621,888.84	-2.69 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	23,122,868.95	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	15,987.13	0.0691 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	1,129.75	0.0049 %
Kayda Alma Ücreti	329.11	0.0014 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	1,201.88	0.0052 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	4,586.71	0.0198 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	59.29	0.0003 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	1,818.50	0.0079 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	0.01	0.0000 %
Diğer Harcamalar	77.37	0.0003 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	25,189.75	0.1089 %
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	0.000	0.00	22,814,217.000	22,814,217.00



FON RİSK RAPORU

30.10.2020

DDA - Deniz Portföy Altıncı Serbest Fon

Fon Bilgileri	Fon ve Kıstas RMD Trendi
---------------	--------------------------

Fon Portföy Değeri	36,288,409.98
Fon Toplam Değeri	22,854,791.87
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	1.17
Fon Kıtası	%60 BIST 30 GETİRİ + %40 BIST-KYD ÖSBA Eurobond USD (TL)

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

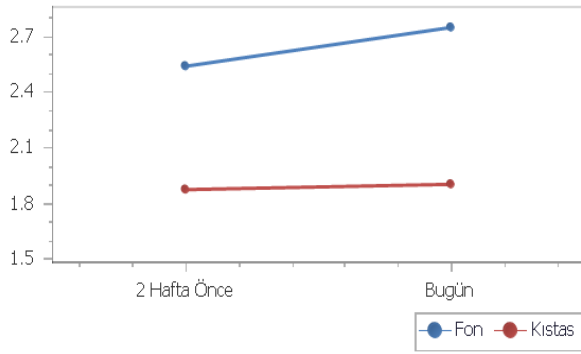
Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

RMD Özeti

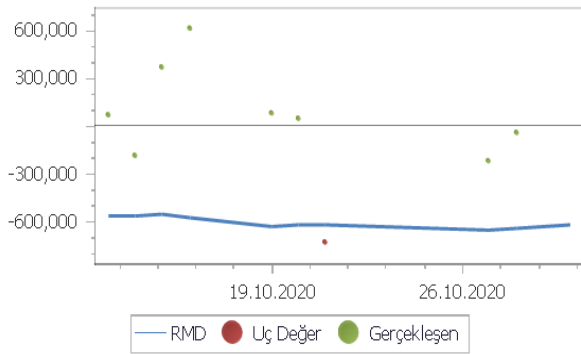
	Fon	Kıtas	Görel	Limit
RMD	627,193.67	435,724.52	1.44	2.00
RMD (%)	2.74	1.91	1.44	
Beklenen Kayıp	720,491.42	500,540.41	1.44	
Beklenen Kayıp (%)	3.15	2.19	1.44	
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

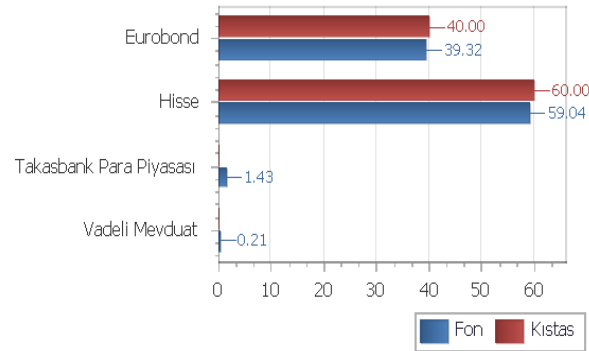
Piyasa	Büyük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	48,563	-66	0.00
Takasbank Para Piyasası	330,384	115	0.00
Hisse	13,634,600	414,471	1.81
Eurobond	9,080,400	-12,410	-0.05
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı ve Kıtas Karşılaştırması



Stress Testi

