

DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST FON

K-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	:	16,938,137.11
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	14,796,906.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	03 Temmuz 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.144708
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.134489
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.90
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	4.47
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	5.37
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	99.45
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.00
f-) TPP	:	0.55
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	:	0.745
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	:	2.98

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ				
Özel Sektör				
TRFAKBKA2026	04/12/20	12,540,000.00	12,526,662.32	81.07
TRFAKBKA2026	04/12/20	-1,500,000.00	-1,498,155.00	-9.70
	TOPLAM:	11,040,000.00	11,028,507.32	71.37
TPP				
TPP	01/12/20	62,027.18	62,027.18	0.40
	TOPLAM:	62,027.18	62,027.18	0.40
BORÇLANMA SENETLERİ				

Özel Sektör

TRDABVKA2017	23/12/20	500,000.00	496,781.82	3.22
TRDABVK32122	23/03/21	4,000,000.00	3,864,065.86	25.01
TOPLAM:		4,500,000.00	4,360,847.68	28.23
PORTFÖY DEĞERİ:		15,602,027.18	15,451,382.18	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	15,451,382.18	91.22 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,566.47	0.03 %
C-)ALACAKLAR	1,498,152.96	8.84 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-16,964.50	-0.10 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	16,938,137.11	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	6,742.44	0.0398 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	253.17	0.0015 %
Kayda Alma Ücreti	267.51	0.0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	4,064.60	0.0240 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	71.10	0.0004 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	151.45	0.0009 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	686.38	0.0041 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	-0.01	0.0000 %
Diğer Harcamalar	573.91	0.0034 %
BİST KYD Ücreti	10.82	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	12,821.37	0.0758 %
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	286,246.000	325,673.91	5,493.000	6,248.62

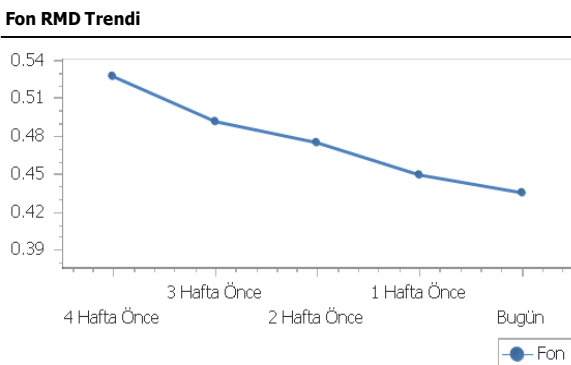


FON RİSK RAPORU

30.11.2020

DDC - Deniz Portföy Dördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri	Fon RMD Trendi
Fon Portföy Değeri	15,451,382.18
Fon Toplam Değeri	16,938,137.11
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.21
Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi	
Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00



Kaldıraç Oranı Limit : 5.00

RMD Özeti

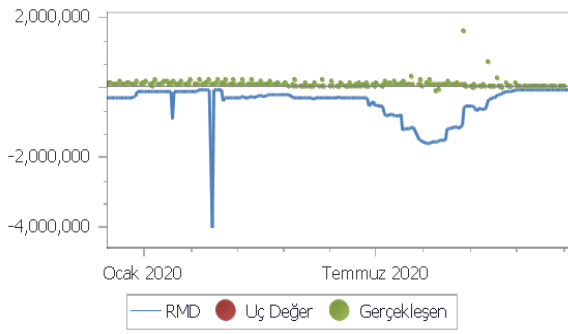
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	73,719.46			
RMD (%)	0.44			5.59
Beklenen Kayıp	84,685.55			
Beklenen Kayıp (%)	0.50			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

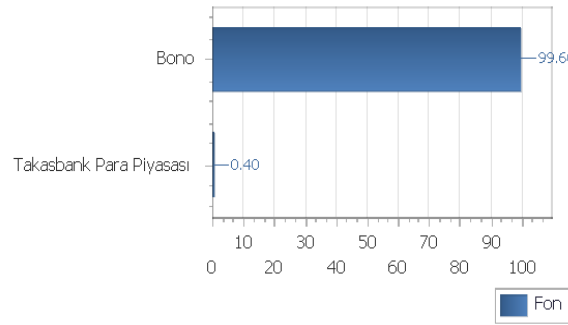
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	62,027	15	0.00
Bono	15,389,355	73,636	0.43

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

Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

