

DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST FON

Ş-2020

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST
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	:	299,787,645.32
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	268,631,684.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	03 Temmuz 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.115980
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.107535
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.76
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.85
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	:	2.66
e-)Devlet Tahvili Repo	:	5.97
f-) TPP	:	0.08
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	90.39
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.90
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	13.043
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	:	1.58

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFNURL42018	16/04/20	2,500,000.00	2,467,518.90	0.84
TRSAKYB72013	01/07/20	1,400,000.00	1,321,046.87	0.45
TRSAKYB62113	24/06/21	5,000,000.00	4,363,829.46	1.48
TRSAKYB62113	24/06/21	-5,000,000.00	-4,512,400.00	-1.53
	TOPLAM:	3,900,000.00	3,639,995.23	1.24

T.REPO

TRT080720T19	02/03/20	1,023,830.00	1,000,903.29	0.34
TRT120128T11	02/03/20	2,319,090.00	3,002,709.86	1.02
TRT180123T10	02/03/20	19,348,410.00	19,017,162.47	6.44
	TOPLAM:	22,691,330.00	23,020,775.62	7.80

MEVDUAT

Mevduat	03/03/20	15,000,000.00	102,936,505.63	34.83
Mevduat	03/03/20	4,000,000.00	27,449,546.87	9.29
Mevduat	03/03/20	15,000,000.00	15,284,034.85	5.17
Mevduat	03/03/20	6,000,000.00	41,173,757.34	13.94
Mevduat	03/03/20	15,000,000.00	15,258,159.90	5.17
Mevduat	03/03/20	3,000,000.00	20,579,061.78	6.97
Mevduat	03/03/20	7,500,000.00	51,447,654.50	17.42
	TOPLAM:	65,500,000.00	274,128,720.87	92.79

TPP

TPP	02/03/20	14,012.66	14,012.66	0.00
	TOPLAM:	14,012.66	14,012.66	0.00

TÜREV

EUR/TRY 6,6561 43395	03/03/20	-3,000,000.00	-623,412.00	-0.21
EUR/TRY 6,6561 43396	03/03/20	-221.31	-48.73	0.00
EUR/TRY 6,6680 43391	03/03/20	-7,500,000.00	-1,469,280.00	-0.50
EUR/TRY 6,6680 43392	03/03/20	-553.28	-115.25	0.00
EUR/TRY 6,7286 43089	03/03/20	-4,000,000.00	-541,216.00	-0.18
EUR/TRY 6,7286 43090	03/03/20	-1,885.00	-278.42	0.00
EUR/TRY 6,7306 43072	03/03/20	-15,000,000.00	-1,999,560.00	-0.68
EUR/TRY 6,7306 43084	03/03/20	-7,174.00	-1,045.28	0.00
EUR/TRY 6,7367 43103	03/03/20	-6,000,000.00	-763,224.00	-0.26
EUR/TRY 6,7367 43104	03/03/20	-2,746.46	-383.42	0.00
	TOPLAM:	-35,512,580.05	-5,398,563.10	-1.83

PORTFÖY DEĞERİ:

56,592,762.61 295,404,941.28 100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
----------	-------	-------

A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	295,404,941.28	98.54 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1,670.19	0.00 %
C-)ALACAKLAR	4,512,400.00	1.51 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-131,366.15	-0.04 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	299,787,645.32	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda	2,850.01	0.0010 %
Ödenen Komisyonlar	112,161.21	0.0374 %
Fon Yönetim Ücreti	244.44	0.0001 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan	14,945.88	0.0050 %
Giderleri	198.01	0.0001 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri	629.72	0.0002 %
İçin Ödenen Ücretler	140.77	0.0000 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	1,322.67	0.0004 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen	19.18	0.0000 %
Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar		
BİST KYD Ücreti		
Otomatik BPP Faiz BSMV		
TOPLAM:	132,511.89	0.0442 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ 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	3,418,970.000	3,785,052.89	76,741,603.000	85,042,767.40



FON RİSK RAPORU

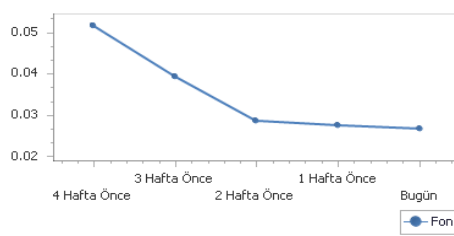
28.02.2020

DDC - Deniz Portföy Dördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	295,404,941.28
Fon Toplam Değeri	299,787,645.32
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.01

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	1,362.96	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.81	Limit : 5.00

RMD Özeti

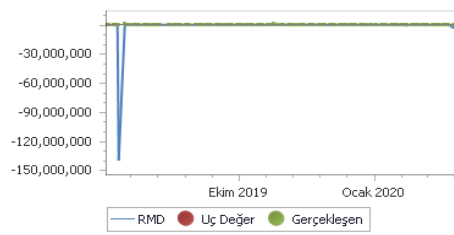
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	80,202.27			
RMD (%)	0.03			5.59
Beklenen Kayıp	92,132.71			
Beklenen Kayıp (%)	0.03			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

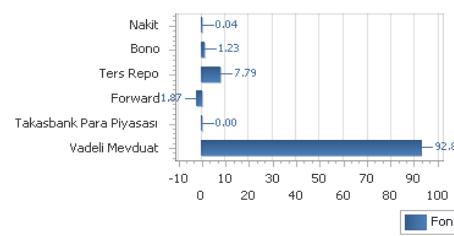
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	274,128,721	-2,670,710	-0.89
Takasbank Para Piyasası	14,013	17	0.00
Forward	-5,511,617	-2,851,008	-0.95
Ters Repo	23,020,776	27,113	0.01
Bono	3,639,995	6,982	0.00
Nakit	113,054	0	0.00

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-243,587,889	-2,851,008	-0.95
EUR/TRY 6,6561 43395	-20,577,600	-190,066	-0.06
EUR/TRY 6,6561 43396	-1,518	-2	0.00
EUR/TRY 6,6680 43391	-51,444,000	-554,318	-0.18
EUR/TRY 6,6680 43392	-3,795	-6	0.00

Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



EUR/TRY 6,7286 43089	-27,436,800	-269,787	-0.09
EUR/TRY 6,7286 43090	-12,930	-21	0.00
EUR/TRY 6,7306 43072	-102,888,000	-1,169,505	-0.39
EUR/TRY 6,7306 43084	-49,208	-80	0.00
EUR/TRY 6,7367 43103	-41,155,200	-431,840	-0.14
EUR/TRY 6,7367 43104	-18,839	-30	0.00

Stress Testi

