

DDC-DENİZ PORTFÖY DÖRDÜNCÜ SERBEST FON**A-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	:	164,078,359.61
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	141,120,361.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	03 Temmuz 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.162684
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.163328
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-0.06
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6.11
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	12.18
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	99.14
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0.55
f-) TPP	:	0.12
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.19
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	9.294
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	:	237.52

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFNURL92013	02/09/20	5,000,000.00	4,998,256.77	3.04
TRFNURL92021	11/09/20	5,000,000.00	4,982,634.72	3.04
TRFDNFK92016	18/09/20	4,200,000.00	4,178,701.71	2.55
TRFISFA92015	25/09/20	2,020,000.00	2,008,073.08	1.22
TRFHFLKE2012	01/10/20	5,000,000.00	4,966,338.15	3.02
TRFAKBKA2026	04/12/20	20,000,000.00	19,437,753.14	11.84
TRFDZBK32148	05/03/21	9,520,000.00	9,062,257.13	5.52
TRFDZBK32122	19/03/21	15,300,000.00	15,221,368.62	9.27

TRSDZBK12218	21/01/22	4,500,000.00	3,919,528.40	2.39
TRSDZBK12226	21/01/22	26,200,000.00	22,845,934.57	13.92
TRSDZBKK2110	12/11/21	35,000,000.00	35,057,336.21	21.36
TRSDZBK52214	27/05/22	36,000,000.00	30,256,499.27	18.43
TOPLAM:		167,740,000.00	156,934,681.77	95.60

T.REPO

TRT280628T18	01/09/20	1,037,225.00	1,500,404.79	0.91
TOPLAM:		1,037,225.00	1,500,404.79	0.91

TPP

TPP	01/09/20	495,141.04	495,141.04	0.30
TOPLAM:		495,141.04	495,141.04	0.30

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRDABVK92027	24/09/20	500,000.00	496,820.96	0.30
TRDHVKA2017	06/10/20	500,000.00	513,749.34	0.31
TRDABVKA2017	23/12/20	500,000.00	483,688.82	0.29
TRDABVK32122	23/03/21	4,000,000.00	3,757,028.16	2.29
TOPLAM:		5,500,000.00	5,251,287.28	3.19
PORTFÖY DEĞERİ:		174,772,366.04	164,181,514.88	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	164,181,514.88	100.06 %
B-)HAZIR DEĞERLER	4,453.41	0.00 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-107,608.68	-0.07 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	164,078,359.61	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	82,661.60	0.0504 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	244.44	0.0001 %
Tescil ve İlan Giderleri	3,726.97	0.0023 %
Kayda Alma Ücreti	14,914.36	0.0091 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	2,843.17	0.0017 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	163.24	0.0001 %
Portföye Alımlarda ve portföyden	656.60	0.0004 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0.01	0.0000 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	554.12	0.0003 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	15.88	0.0000 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar		
BİST KYD Ücreti		
Otomatik BPP Faiz BSMV		
TOPLAM:	105,780.39	0.0644 %

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	75,021,653.000	87,560,790.44	7,274,435.000	8,473,523.58

DDC - Deniz Portföy Dördüncü Serbest Fon-31.08.2020 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	164,181,514.88
Fon Toplam Değeri	164,078,359.61
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.31

RMD Özeti

	Fon			Limit
RMD	1,166,322.35			
RMD (%)	0.71			5.59
Beklenen Kayıp	1,339,817.79			
Beklenen Kayıp (%)	0.82			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	495,141	-33	0.00
Ters Repo	1,500,405	-100	0.00
Bono	162,185,969	1,164,306	0.71