

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	:	43,538,881.10
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	38,174,218.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	03 Temmuz 2019
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.140531
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.162684
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	-1.91
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	4.09
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	8.20
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.00
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	96.30
e-)Devlet Tahvili Repo	:	3.47
f-) TPP	:	0.14
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.09
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	4.489
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	:	279.08

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRFHLFKE2012	01/10/20	5,000,000.00	5,000,000.00	11.47
TRFAKBKA2026	04/12/20	20,000,000.00	19,615,454.76	44.99
TRSDZBK52214	27/05/22	16,000,000.00	13,558,560.78	31.10
TOPLAM:		41,000,000.00	38,174,015.54	87.56

T.REPO

TRT090621T18	01/10/20	558,120.00	500,164.38	1.15
--------------	----------	------------	------------	------

TOPLAM: 558,120.00 500,164.38 1.15

TPP

TPP	01/10/20	120,041.26	120,041.26	0.28
TOPLAM:		120,041.26	120,041.26	0.28

BORÇLANMA SENETLERİ

Özel Sektör				
TRDHVKA2017	06/10/20	500,000.00	517,496.35	1.19
TRDABVKA2017	23/12/20	500,000.00	487,966.61	1.12
TRDABVK32122	23/03/21	4,000,000.00	3,791,983.61	8.70
TOPLAM:		5,000,000.00	4,797,446.57	11.01
PORTFÖY DEĞERİ:		46,678,161.26	43,591,667.75	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	43,591,667.75	100.12 %
B-)HAZIR DEĞERLER	4,207.71	0.01 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-56,994.36	-0.13 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	43,538,881.10	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	42,609.32	0.0979 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	261.90	0.0006 %
Tescil ve İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	-4,795.74	-0.0110 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	9,910.08	0.0228 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Portföye Alımlarda ve portföyden	1,992.36	0.0046 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	60.82	0.0001 %
Ödemeleri		
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	711.95	0.0016 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	0.07	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	593.70	0.0014 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	12.90	0.0000 %
TOPLAM:	51,357.36	0.1180 %

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	102,946,143.000	118,938,656.71	0.000	0.00



Fon Bilgileri

FON RİSK RAPORU
DDC - Deniz Portföy Dördüncü Serbest Fon

Fon RMD Trendi

30.09.2020

Fon Portföy Değeri	43,591,667.75
Fon Toplam Değeri	43,538,881.10
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.32

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 5.00

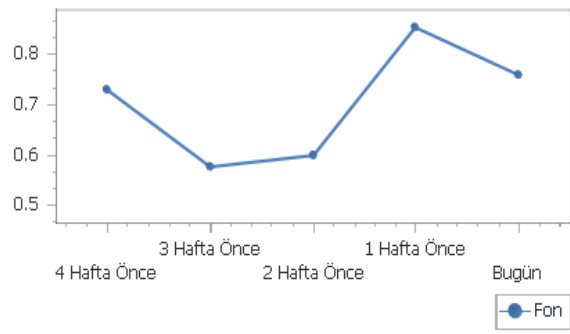
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	329,678.03			
RMD (%)	0.76			5.59
Beklenen Kayıp	378,719.05			
Beklenen Kayıp (%)	0.87			
Uç Değer Adedi	0			

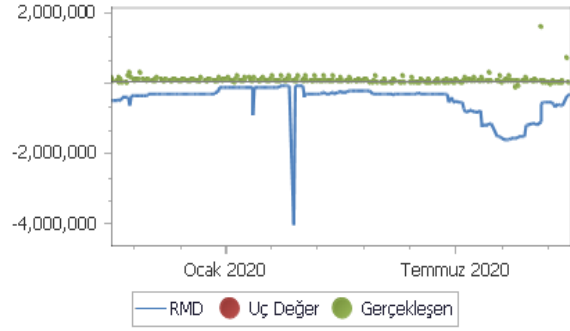
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	120,041	20	0.00
Ters Repo	500,164	82	0.00
Bono	42,971,462	329,038	0.76

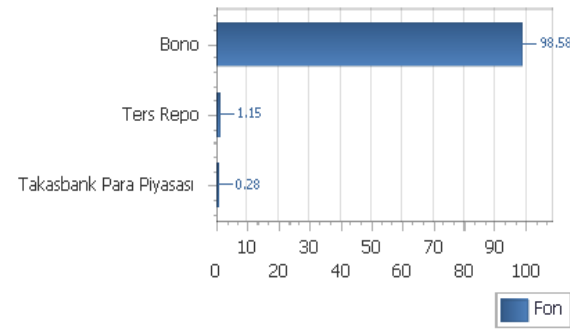
Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
----------------------------	--------------------	-----------	---------------



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

