

DDA-DENİZ PORTFÖY ALTINCI SERBEST FON**K-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	:	27,554,530.20
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	23,534,471.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	08 Ekim 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.170816
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.013529
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	15.52
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	14.65
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	94.75
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	4.05
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	1.03
f-) TPP	:	0.11
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.06
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	2.353
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.03
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	:	45.68

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
AKBNK		853,000.00	5,135,060.00	13.11
AKBNK		500,000.00	3,010,000.00	7.69
GARAN		637,000.00	5,573,750.00	14.24
GARAN		400,000.00	3,500,000.00	8.94
HALKB		210,000.00	1,123,500.00	2.87
HALKB		150,000.00	802,500.00	2.05
ISCTR		481,000.00	3,131,310.00	8.00
ISCTR		300,000.00	1,953,000.00	4.99
VAKBN		250,000.00	1,135,000.00	2.90

VAKBN	150,000.00	681,000.00	1.74
YKBNK	901,000.00	2,576,860.00	6.58
YKBNK	500,000.00	1,430,000.00	3.65
TOPLAM:	5,332,000.00	30,051,980.00	76.76

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	1,000,000.00	9,041,034.15	23.07
TOPLAM:		1,000,000.00	9,041,034.15	23.07

MEVDUAT

Mevduat	01/12/20	5,846.05	45,536.29	0.12
Mevduat	01/12/20	18,000.00	18,006.89	0.05
TOPLAM:		23,846.05	63,543.18	0.17

PORTFÖY DEĞERİ:	6,355,846.05	39,156,557.33	100.00
-----------------	--------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	39,156,557.33	142.11 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,268.67	0.02 %
C-)ALACAKLAR	0.00	0.00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-11,607,295.80	-42.12 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	27,554,530.20	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	21,651.52	0.0786 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	1,310.51	0.0048 %
Tescil ve İlan Giderleri	462.37	0.0017 %
Kayda Alma Ücreti	4,153.75	0.0151 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	2,716.76	0.0099 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	152.04	0.0006 %
Portföye Alımlarda ve portföyden	2,184.67	0.0079 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar	6.80	0.0000 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi		
Adımları		
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına		
Ödenen Denetim Ücreti		
Otomatik BPP Faiz BSMV		
TOPLAM:	32,638.42	0.1186 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE 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	720,254.000	729,998.32



FON RİSK RAPORU

30.11.2020

DDA - Deniz Portföy Altıncı Serbest Fon

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

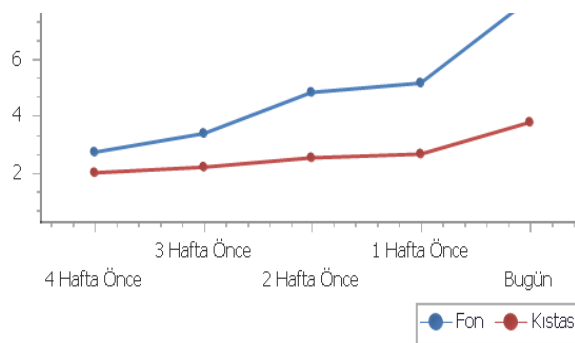
Fon Portföy Değeri	23,093,946.45
--------------------	---------------

Fon Portföy Değeri	23,093,946.45
--------------------	---------------

8



Fon Toplam Değeri	23,122,868.95
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	2.06
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

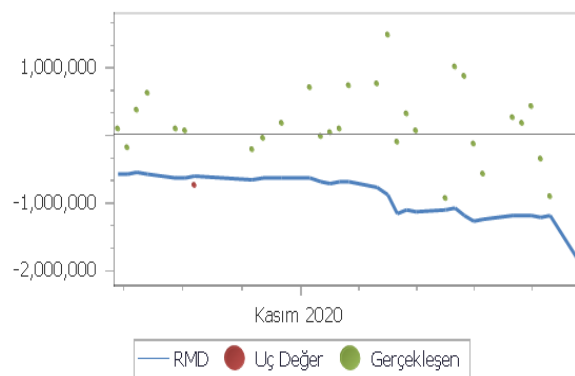
	Fon	Kıtas	Görelî	Limit
RMD	1,874,811.60	875,074.32	2.14	2.00
RMD (%)	8.11	3.78	2.14	
Beklenen Kayıp	2,153,697.86	1,005,245.37	2.14	
Beklenen Kayıp (%)	9.31	4.35	2.14	
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

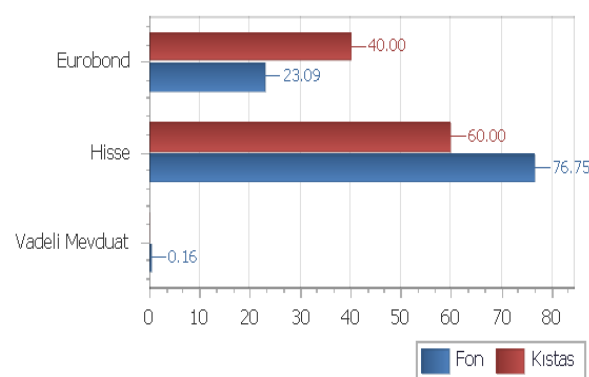
Piyasa	Büyüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	63,543	-323	0.00
Hisse	30,051,980	1,637,171	7.08
Eurobond	9,041,034	-62,505	-0.27

[illegible]

Geriyeye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı ve Kıstas Karşılaştırması



Stress Testi

