

DDA-DENİZ PORTFÖY ALTINCI SERBEST FON**A-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	:	48,114,146.03
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	38,216,571.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	08 Ekim 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.258986
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.170816
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	7.53
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	3.81
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	92.76
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	3.85
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	2.32
f-) TPP	:	0.31
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.76
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	0.00
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	3.822
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.02
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.04
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	11.43

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
AKBNK		1,353,000.00	9,376,290.00	37.96
AKBNK		-660,000.00	-4,573,800.00	-18.52
GARAN		1,037,000.00	10,753,690.00	43.53
GARAN		-506,000.00	-5,247,220.00	-21.24
HALKB		360,000.00	2,001,600.00	8.10
HALKB		-176,000.00	-978,560.00	-3.96
ISCTR		781,000.00	5,467,000.00	22.13
ISCTR		-380,000.00	-2,660,000.00	-10.77
VAKBN		400,000.00	1,884,000.00	7.63

VAKBN	-195,000.00	-918,450.00	-3.72
YKBNK	1,401,000.00	4,315,080.00	17.47
YKBNK	-683,000.00	-2,103,640.00	-8.52
TOPLAM:	2,732,000.00	17,315,990.00	70.09

BORÇLANMA SENETLERİ

Eurobond				
XS1867595750	15/01/24	1,600,000.00	14,090,576.09	57.05
XS1867595750	15/01/24	-800,000.00	-7,049,800.08	-28.54
TOPLAM:		800,000.00	7,040,776.01	28.51

MEVDUAT

Mevduat	04/01/21	24,568.35	182,286.42	0.74
TOPLAM:		24,568.35	182,286.42	0.74

TPP

TPP	04/01/21	170,331.62	170,331.62	0.69
TOPLAM:		170,331.62	170,331.62	0.69

TÜREV

USD/TRY 7,4255 45763	05/01/21	-950,000.00	-7,112.65	-0.03
TOPLAM:		-950,000.00	-7,112.65	-0.03

PORTFÖY DEĞERİ:	2,776,899.97	24,702,271.40	100.00
-----------------	--------------	---------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	24,702,271.40	51.34 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,588.90	0.01 %
C-)ALACAKLAR	23,467,878.02	48.78 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-61,592.29	-0.13 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	48,114,146.03	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	43,625.74	0.0907 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	1,400.89	0.0029 %
Kayda Alma Ücreti	1,431.18	0.0030 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	5,235.64	0.0109 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Portföye Alımlarda ve portföyden	3,680.61	0.0076 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	59.85	0.0001 %
Ödemeleri		
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	2,254.94	0.0047 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	-7.32	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	19.45	0.0000 %
TOPLAM:	57,700.98	0.1199 %

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	2,400,000.000	2,809,958.40	17,082,100.000	19,999,995.99



FON RİSK RAPORU

12.31.2020

DDA - Deniz Portföy Altıncı Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	24,702,271.40
Fon Toplam Değeri	24,702,271.40
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	1.66
Fon Kistası	%60 BIST 30 GETİRİ + %40 BIST-KYD ÖSBA Eurobond USD (TL)

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.29	Limit : 5.00

RMD Özeti

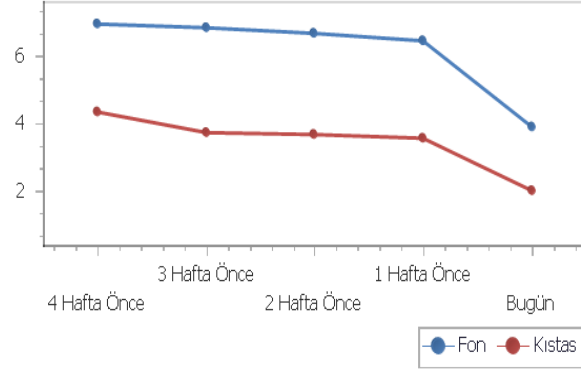
	Fon	Kistas	Görelî	Limit
RMD	955,633.38	494,482.62	1.93	2.00
RMD (%)	3.87	2.00	1.93	
Beklenen Kayıp	1,097,787.94	568,039.02	1.93	
Beklenen Kayıp (%)	4.44	2.30	1.93	
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

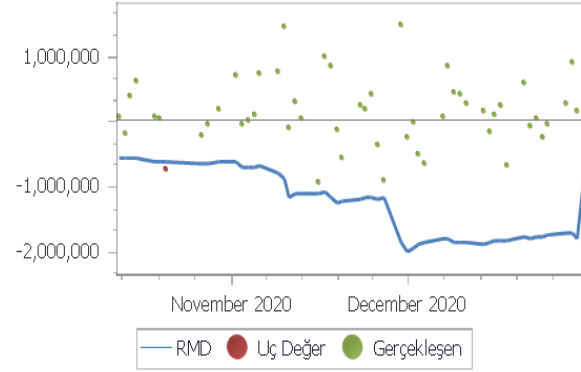
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	182,286	-1,412	-0.01
Takasbank Para Piyasası	170,332	145	0.00
Forward	-10,247	48,187	0.20
Hisse	17,315,990	878,736	3.56
Eurobond	7,040,776	-46,746	-0.19
Nakit	3,134	2	0.00

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyükliği	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-7,048,430	48,187	0.20
USD/TRY 7,4255 45763	-7,048,430	48,187	0.20

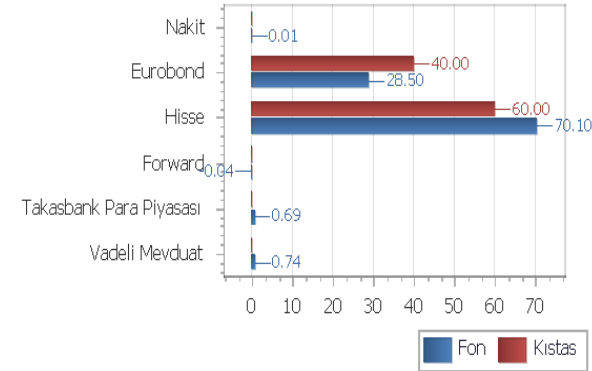
Fon ve Kistas RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı ve Kistas Karşılaştırması



Stress Testi

