

DPI - DENİZ PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Fon Sürekli Bilgilendirme Formu

Fon Sürekli Bilgilendirme Formu

Information About Fund

Fonun Bağlı Olduğu Şemsiye Fonun Türü

SERBEST ŞEMSİYE FON

ISIN Code

TRYDNZP00306

Duration of Fund

SÜRESİZ

Fonun Halka Arz Tarihi

İhraç Sıra Numarası	Halka Arz Tarihi

Main Trading Information

Alım Satım Saatleri	Trading Places	Minimum Share Amount that can be Bought	Valuation Rules	Other Information
Yatırımcıların değerleme günü saat 13.30'a kadar verdikleri katılma payı alım talimatları, talimatın verilmesini takip eden ilk hesaplamada bulunacak pay fiyatı üzerinden değerleme gününü takip eden ilk iş gününde yerine getirilir. Değerleme günü saat 13.30'dan sonra iletilen talimatlar ise, ilk pay fiyatı hesaplamasından sonra verilmiş kabul edilir ve bir sonraki değerlemede bulunan pay fiyatı üzerinden bir sonraki değerleme gününü takip eden ilk iş gününde yerine getirilir. Yatırımcıların belirlenen değerleme günü saat 13.30'a kadar verdikleri katılma payı satım talimatları, talimatın verilmesini takip eden ilk hesaplamada bulunacak pay fiyatı üzerinden yerine getirilir. Değerleme günü saat 13.30'dan sonra iletilen talimatlar ise, ilk pay fiyatı hesaplamasından sonra verilmiş kabul edilir ve bir sonraki değerlemede bulunan pay fiyatı üzerinden yerine getirilir.	Denizbank şubeler	1	Alım talimatının karşılığında tahsil edilen tutar o gün için yatırımcı adına Deniz Portföy Para Piyasası Fonu'nda nemalandırılmak suretiyle bu izahnamede belirtilen esaslar çerçevesinde, katılma payı alımında kullanılır. İleri fiyatlı fon alım talimatına konu tutarların fon alım talimatının gerçekleşeceği günden önceki iş gününde saat 15:30'dan sonra Deniz Portföy Para Piyasası Fonu satışı gerçekleştirilerek nemalandırılır.	

Fon Portföyüne İlişkin Bilgiler

Güncel Fon Bilgilerine Erişilebilecek İnternet Adresi	Fon Portföyüne Dahil Edilecek Türev Araç İşlemleri ile İlgili Genel İlkeler
https://www.denizportfoy.com/yatirim-fonlari/surekli-bilgilendirme/	Fon portföyüne kaldıraç yaratan işlemlerden; döviz, faiz, pay senedi, pay senedi endeksleri, emtia ve sermaye piyasası araçlarına dayalı türev araç (vadeli işlem ve opsiyon sözleşmeleri), saklı türev araç, swap sözleşmesi, varant, sertifika, ileri valörlü tahvil/bono ve altın işlemleri ve diğer herhangi bir yöntemle kaldıraç yaratan işlemler benzeri işlemler dahil edilecektir. Fonun kaldıraç limiti %1000'dir.

Fonun Yatırım Stratejisi ve Risk Değeri

Yatırım Stratejisi	Risk Değeri
Borsa İstanbul'da işlem gören; ortaklık paylarında, ortaklık paylarına ait rüçhanlarda, varantlarda, vadeli işlem sözleşmeleri, opsiyon sözleşmeleri ve diğer türev araçlarda gün içinde gerçekleşebilecek fiyat uyumsuzluklarını ve istatistiksel arbitraj fırsatlarını algoritma destekli sistemler ile değerlendirerek sermaye kazancı sağlamayı ve portföy değerinin artırmayı amaçlamaktadır. Fon, söz konusu yatırım stratejisi sonucu oluşan pozisyon risklerini uygun görülen yüksek korelasyonlu yurt içi ve yurt dışı finansal ürünler yardımıyla hedge etmeyi amaçlamaktadır. Bu finansal ürünler yurt içi ortaklık paylarına, pay endekslerine ve döviz dayalı spot işlemler olabileceği gibi bu varlıklara dayalı forward, swap ve opsiyon gibi türev sözleşmeler de olabilir. Fon tarafından, yukarıda belirtilmeyen yerli ve/veya yabancı para ve sermaye piyasası araçlarına ve bu araçlara dayalı türev işlem ve sözleşmelere de borsada veya borsa dışında yatırım yapabilecektir. Söz konusu işlemler yurt içi ve/veya yurt dışında organize piyasalarda ve/veya tezgahüstü olarak yapılabilir. Fonun, katılma payları sadece nitelikli yatırımcılara satılacak serbest fon niteliğinde olmasından dolayı fonun yatırım stratejisinde yer alan sınırlamalar haricinde herhangi bir sınırlama ve yönetim kısıtlaması bulunmamaktadır.	

Commission and Expense Information

Fund Management Fee Rates And Purchase Redemption Commissions

--

İhraç Sıra Numarası	Fon İktüzüğünde Yer Alan Yönetim Ücreti Oranı (G�nl�k) (%)	Fon İkt�z�ğ�ndeYer Alan Y�netim �creti Oranı (Yıllık) (%)	Uygulanan Y�netim �creti Oranı (G�nl�k) (%)	Uygulanan Y�netim �creti Oranı (Yıllık) (%)	Purchase Commission (%)	Purchase Commission Info	Redemption Commission (%)	Redemption Commission Info	Performance Fee Rate (%)
1	0,007535	2,75	0,007535	2,75	0	-	0	-	25

Fon M d r  ve Portf y Y neticileri

Fund Manager

Name-Surname	Appointment Date	Experience in Capital Markets (Year)	Licenses Owned
SERAP DEM�RAL	28.09.2015	25	SPF D�zey 3 Lisansı - T�rev Ara�lar Lisansı

Fon Portf y Y neticileri

Name-Surname	Appointment Date	Jobs in Last 5 Years (Year-Company-Position)	Experience in Capital Markets (Year)	Licenses Owned
F�GEN KILI� ERG�ZEL	01.06.2003	Deniz Portf�y Y�netimi A.�./Fon ve Portf�y Y�netimi Genel M�d�r Yardımcısı	15	SPF D�zey 3 Lisansı - T�rev Ara�lar Lisansı
MURAT �ZKAN	01.08.2018	Deniz Portf�y Y�netimi A.�. / İ� Geli�tirme ve Proje Fonlar B�l�m M�d�r Deniz Portf�y Y�netimi A.�. / Tefti� Kurulu Ba�kanı (2014-2018)	14	SPF D�zey 3 Lisansı - T�rev Ara�lar Lisansı
SERKAN T�RK	26.10.2015	Deniz Portf�y Y�netimi A.�./Portf�y Y�neticisi-B�l�m M�d�r�	17	SPF D�zey 3 Lisansı - T�rev Ara�lar Lisansı
BAHADİR DO�U�	06.08.2018	Deniz Portf�y Y�netimi A.�. /Portf�y Y�neticisi - B�l�m M�d�r�	22	SPF D�zey 3 Lisansı - T�rev ara�lar Lisansı

Communication Information

Adress, Phone and Fax

Adress	Phone	Fax	E-mail
B�y�kdere Cad.Deniz Tower No:141 Kat:19 Esentepe /İstanbul	212 348 2000	212 348 3062	FonHizmet@denizbank.com

Contact Persons

Name-Surname	Position	Phone	E-mail
SERAP DEM�RAL	FON M�D�R�	212 348 3650	Serap.Demiral@denizbank.com
ATAKAN İ�IK	Y�NETMEN	Y�NETMEN	Atakan.Isk@denizbank.com