

DPI - DENİZ PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Fon Sürekli Bilgilendirme Formu

Fon Sürekli Bilgilendirme Formu

Fona İlişkin Bilgiler

Fonun Halka Arz Tarihi

İhraç Sıra Numarası	Halka Arz Tarihi
	02.03.2020

Portföy Yöneticisi Kuruluş

İhraç Sıra Numarası	Portföy Yöneticisi Kuruluşun Ticaret Unvanı
	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.

Temel Alım Satım Bilgileri

Alım Satım Saatleri	Alım Satım Yerleri	Alınabilecek Asgari Pay Adedi	Nemalandırma Esasları	Diğer Önemli Bilgiler
Yatırımcıların değerlendirme günü saat 13.30'a kadar verdikleri katılma payı alım talimatları, talimatın verilmesini takip eden ilk hesaplamada bulunacak pay fiyatı üzerinden değerlendirme 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 değerlendirme bulunan pay fiyatı üzerinden bir sonraki değerlendirme gününü takip eden ilk iş gününde yerine getirilir. Yatırımcıların belirlenen değerlendirme 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 değerlendirme 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 gerçekleştirileceği günden önceki iş gününde saat 15:30'dan sonra Deniz Portföy Para Piyasası Fonu satışı gerçekleştirilerek nemalandırılır.	

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 dövizde 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 yapılabilecektir. 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.	2

Fon Müdürü ve Portföy Yöneticileri

Fon Müdürü

Adı Soyadı	Göreve Atanma Tarihi	Sermaye Piyasası Alanında Tecrübesi (Yıl)	Sahip Olunan Lisanslar
SERPİL ASLAN BEKTAŞ	01.08.2020	12	SPF Düzey 3 Lisansı - Türev Araçlar Lisansı

İletişim Bilgileri

İletişim Adresi, Telefon ve Faks Bilgileri

Adres	Telefon	Fax	e-Posta
Büyükdere Cad.Deniz Tower No:141 Kat:19 Esentepe /İstanbul	212 348 2000	212 348 5127	FonHizmet@denizbank.com

Bağlantı Kurulacak Yetkililer

Adı Soyadı	Görev	Telefon	e-Posta
SERPİL ASLAN BEKTAŞ	FON MÜDÜRÜ	212 348 5127	Serpil.Aslanbektas@denizbank.com
ATAKAN IŞIK	YÖNETMEN	YÖNETMEN	Atakan.Isk@denizbank.com