

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**M-2020****I-FONU TANITICI BİLGİLER**

A-)Fonun Adı	:	DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	300,000,000.00
E-)Fon Pay Sayısı	:	300,000,000.00
F-)Fon Toplam Değeri	:	2,020,443.59
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	2,000,000.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.010222
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	0.000000
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.00
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	10.19
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	39.52
f-) TPP	:	7.25
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	18.76
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	24.28
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	0.667
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	1.06
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	:	0.00

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
BIMAS		6,800.00	341,020.00	17.24
BIMAS		-700.00	-35,105.00	-1.78
FROTO		100.00	4,928.00	0.25
KOZAL		5,000.00	306,750.00	15.51
KOZAL		-100.00	-6,135.00	-0.31
MGROS		100.00	2,266.00	0.12
PGSUS		100.00	3,420.00	0.17
TOASO		100.00	1,645.00	0.08

TSKB		47,700.00	44,838.00	2.27
ULKER		100.00	1,965.00	0.10
TOPLAM:		59,200.00	665,592.00	33.65

MEVDUAT

Mevduat	01/04/20	752,000.00	752,205.46	38.03
TOPLAM:		752,000.00	752,205.46	38.03

VOB Nakit Teminatı

		560,124.80	560,124.80	28.32
TOPLAM:		560,124.80	560,124.80	28.32

PORTFÖY DEĞERİ:		1,371,324.80	1,977,922.26	100.00
-----------------	--	--------------	--------------	--------

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	1,977,922.26	97.90 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,689.02	0.28 %
C-)ALACAKLAR	233,454.00	11.55 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-196,621.69	-9.73 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	2,020,443.59	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	4,540.36	0.2247 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	4,029.75	0.1994 %
Kayda Alma Ücreti	33.30	0.0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	1,715.80	0.0849 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Portföye Alımlarda ve portföyden	842.66	0.0417 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	58.84	0.0029 %
Ödemeleri		
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	807.30	0.0400 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	-1.80	-0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	11.69	0.0006 %
TOPLAM:	12,037.90	0.5957 %

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
FROTO	Temmettü	25/03/20	312.00	312.00
TOASO	Temmettü	27/03/20	8,640.00	8,640.00

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	2,000,000.000	2,000,000.00



Fon Bilgileri

FON RİSK RAPORU

31.03.2020

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon

Fon RMD Trendi

Fon Portföy Değeri	2,000,546.45
Fon Toplam Değeri	2,000,352.77
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.03

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.33	Limit : 10.00

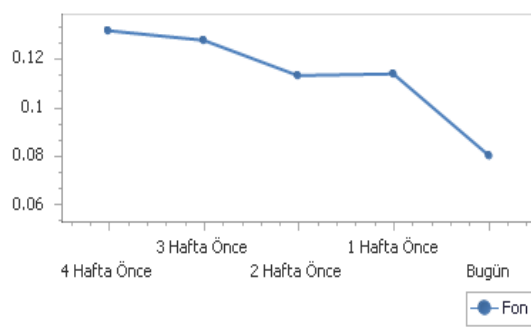
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1,591.82			
RMD (%)	0.08			5.59
Beklenen Kayıp	1,828.61			
Beklenen Kayıp (%)	0.09			
Uç Değer Adedi	5			

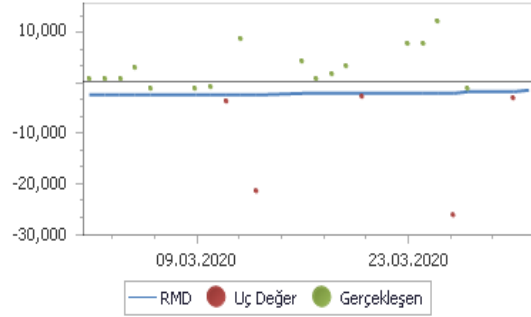
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	752,205	912	0.05
Teminat	560,125	679	0.03
Hisse	665,592	-37,555	-1.88
Futures	954	-37,465	-1.87
Nakit	-954	0	0.00

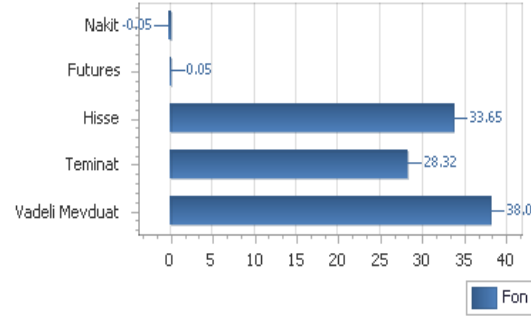
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-665,592	-37,465	-1.87
F_BIMAS0320	-305,915	-18,373	-0.92
F_FROTO0320	-4,928	-29	0.00
F_KOZAL0320	-300,615	-23,335	-1.17
F_MGROS0320	-2,266	-21	0.00
F_PGSUS0320	-3,420	-47	0.00
F_TOASO0320	-1,645	12	0.00



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



F_TSKB0520	-44,838	-2,104	-0.11
F_ULKER0320	-1,965	-1	0.00

Stress Testi

