

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**T-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	:	119,318,455.46
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	112,195,621.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.063486
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.045678
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.70
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.59
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	75.71
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	7.99
f-) TPP	:	0.20
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.06
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	16.04
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	37.433
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.29
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				
AKBNK		2,063,500.00	10,812,740.00	8.92
AKBNK		-771,800.00	-4,044,232.00	-3.34
ASELS		240,000.00	8,462,400.00	6.98
BIMAS		200.00	14,290.00	0.01
BIMAS		217,100.00	15,511,795.00	12.80
CCOLA		97,100.00	4,332,602.00	3.58
CCOLA		-89,300.00	-3,984,566.00	-3.29
EKGYO		283,700.00	635,488.00	0.52
EKGYO		-258,700.00	-579,488.00	-0.48

ENJSA		77,200.00	639,988.00	0.53
ENJSA		25,900.00	214,711.00	0.18
ENKAI		2,120.00	13,758.80	0.01
ENKAI		8,580.00	55,684.20	0.05
EREGL		102,400.00	782,336.00	0.65
EREGL		-101,800.00	-777,752.00	-0.64
FROTO		200.00	16,600.00	0.01
GARAN		1,564,200.00	10,980,684.00	9.06
GARAN		-301,200.00	-2,114,424.00	-1.75
HALKB		232,400.00	1,282,848.00	1.06
HALKB		-222,400.00	-1,227,648.00	-1.01
ISCTR		196,100.00	941,280.00	0.78
ISCTR		330,800.00	1,587,840.00	1.31
KOZAL		23,500.00	2,031,575.00	1.68
MGROS		165,100.00	7,389,876.00	6.10
SAHOL		135,100.00	1,132,138.00	0.93
SAHOL		-8,000.00	-67,040.00	-0.06
SASA		4,400.00	59,532.00	0.05
SASA		-4,200.00	-56,826.00	-0.05
SODA		713,800.00	4,653,976.00	3.84
SODA		-89,200.00	-581,584.00	-0.48
TAVHL		381,200.00	6,327,920.00	5.22
TAVHL		-224,500.00	-3,726,700.00	-3.08
TCELL		291,700.00	4,334,662.00	3.58
TCELL		524,900.00	7,800,014.00	6.44
TKFEN		461,000.00	7,053,300.00	5.82
TKFEN		-29,800.00	-455,940.00	-0.38
TOASO		100,300.00	2,549,626.00	2.10
TOASO		-68,500.00	-1,741,270.00	-1.44
TTKOM		4,000.00	28,960.00	0.02
TTKOM		91,900.00	665,356.00	0.55
TUPRS		212,700.00	17,558,385.00	14.51
TUPRS		-175,300.00	-14,471,015.00	-11.94
ULKER		400.00	10,424.00	0.01
ULKER		160,200.00	4,174,812.00	3.44
VAKBN		2,269,100.00	10,210,950.00	8.43
VAKBN		-1,211,700.00	-5,452,650.00	-4.50
YKBNK		1,009,500.00	2,160,330.00	1.78
YKBNK		-909,500.00	-1,946,330.00	-1.61
	TOPLAM:	7,524,400.00	93,199,416.00	76.90

T.REPO

TRT120820T12	04/08/20	464,440.00	500,582.19	0.41
	TOPLAM:	464,440.00	500,582.19	0.41

VOB Nakit Teminatı

		27,493,434.87	27,493,434.87	22.69
	TOPLAM:	27,493,434.87	27,493,434.87	22.69
PORTFÖY DEĞERİ:		35,482,274.87	121,193,433.06	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
----------	-------	-------

A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	121,193,433.06	101.57 %
B-)HAZIR DEĞERLER	8,210.12	0.01 %
C-)ALACAKLAR	82,931,157.88	69.50 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-84,814,345.60	-71.08 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	119,318,455.46	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	303,358.66	0.2542 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	428.06	0.0004 %
Kayda Alma Ücreti	1,878.49	0.0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	9,756.74	0.0082 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	78,399.15	0.0657 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	60.95	0.0001 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	1,348.41	0.0011 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	94.30	0.0001 %
Diğer Harcamalar	19.58	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV		
TOPLAM:	395,344.34	0.3314 %

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
EREGL	Temmettü	21/07/20	0.00	6,900.00
ASELS	Temmettü	21/07/20	0.00	1,302.78
EKGYO	Temmettü	27/07/20	0.00	504.25

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	1,074,072.000	1,123,133.46	50,779,496.000	53,099,001.82

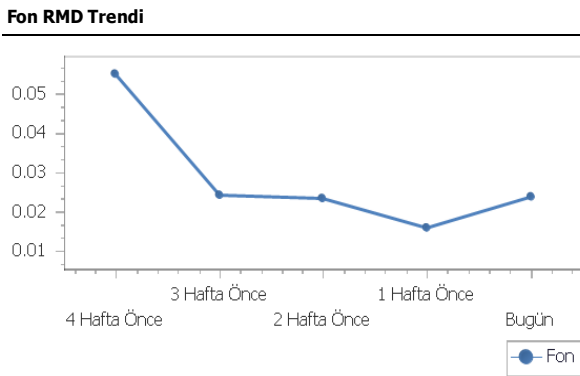


FON RİSK RAPORU

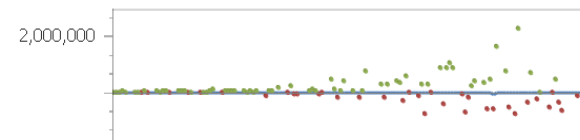
30.07.2020

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon

Fon Bilgileri	Fon RMD Trendi
Fon Portföy Değeri	121,193,433.06
Fon Toplam Değeri	119,318,455.46
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.01
Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi	
Açık Pozisyon Tutarı	0.00
Limit : 1.00	
Kaldıraç Oranı	0.78
Limit : 10.00	



Geriye Dönük Test



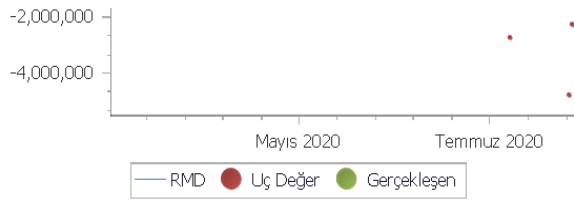
RMD Özeti	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	28,662.16			
RMD (%)	0.02			5.59
RMD Standart Sapması	23,025.78			

Beklenen Kayıp	32,925.78			
Beklenen Kayıp (%)	0.03			
Uç Değer Adedi	38			

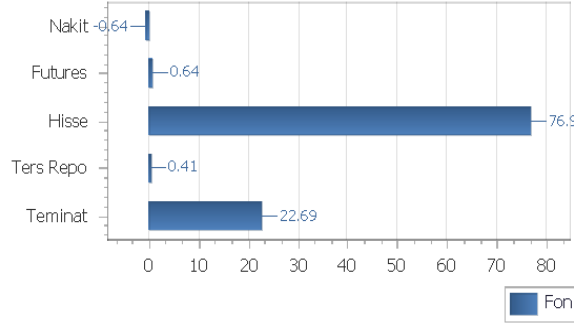
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Teminat	27,493,435	28,150	0.02
Ters Repo	500,582	512	0.00
Hisse	93,199,416	-2,936,501	-2.46
Futures	779,718	-3,057,146	-2.56
Nakit	-779,718	0	0.00

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-93,199,416	-3,057,146	-2.56



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

