

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**K-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	:	126,866,100.79
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	113,331,477.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.119425
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.099270
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.83
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.62
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	80.15
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	5.28
f-) TPP	:	0.65
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	13.92
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	37.777
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.27
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		40,000.00	240,800.00	0.21
AKBNK		960,000.00	5,779,200.00	4.94
ARCLK		50,000.00	1,363,000.00	1.16
EKGYO		4,000,000.00	8,640,000.00	7.38
ENJSA		13,900.00	150,120.00	0.13
ENJSA		357,700.00	3,863,160.00	3.30
FROTO		18,000.00	1,940,400.00	1.66
GARAN		10,000.00	87,500.00	0.08
GARAN		1,530,900.00	13,395,375.00	11.44

GUBRF	113,900.00	5,888,630.00	5.03
GUBRF	52,300.00	2,703,910.00	2.31
ISCTR	10,000.00	65,100.00	0.06
ISCTR	5,900.00	38,409.00	0.03
KOZAA	8,900.00	112,763.00	0.10
KOZAA	26,700.00	338,289.00	0.29
KOZAL	25,500.00	1,898,475.00	1.62
KOZAL	-17,100.00	-1,273,095.00	-1.09
MGROS	57,300.00	2,416,914.00	2.06
MGROS	500.00	21,090.00	0.02
PETKM	658,800.00	2,760,372.00	2.36
PETKM	781,200.00	3,273,228.00	2.80
SASA	45,300.00	738,843.00	0.63
SOKM	64,100.00	805,096.00	0.69
SOKM	248,300.00	3,118,648.00	2.66
TCELL	1,819,500.00	26,928,600.00	23.00
TCELL	-1,125,900.00	-16,663,320.00	-14.23
TKFEN	2,000.00	29,100.00	0.03
TKFEN	98,000.00	1,425,900.00	1.22
TOASO	53,500.00	1,524,750.00	1.30
TOASO	-3,800.00	-108,300.00	-0.09
TSKB	11,260,000.00	25,785,400.00	22.03
TSKB	-9,400,000.00	-21,526,000.00	-18.39
TUPRS	94,100.00	8,558,395.00	7.31
TUPRS	-10,500.00	-954,975.00	-0.82
ULKER	331,300.00	7,354,860.00	6.28
ULKER	66,100.00	1,467,420.00	1.25
VAKBN	20,000.00	90,800.00	0.08
VAKBN	300,000.00	1,362,000.00	1.16
YKBNK	762,500.00	2,180,750.00	1.86
YKBNK	-718,800.00	-2,055,768.00	-1.76
TOPLAM:	12,610,100.00	93,765,839.00	80.10

TPP

TPP	01/12/20	62,027.18	62,027.18	0.05
TOPLAM:		62,027.18	62,027.18	0.05

VOB Nakit Teminatı

	23,236,815.27	23,236,815.27	19.85
TOPLAM:	23,236,815.27	23,236,815.27	19.85
PORTFÖY DEĞERİ:	35,908,942.45	117,064,681.45	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	117,064,681.45	92.27 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,514.81	0.00 %
C-)ALACAKLAR	107,915,638.22	85.06 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-98,117,733.69	-77.34 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %

FON TOPLAM DEĞERİ 126,866,100.79 100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	73,392.58	0.0579 %
Fon Yönetim Ücreti	274,738.15	0.2166 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	365.11	0.0003 %
Kayda Alma Ücreti	2,009.68	0.0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	10,319.95	0.0081 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	157.49	0.0001 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	1,291.33	0.0010 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1,336.79	0.0011 %
Diğer Harcamalar	380.00	0.0003 %
BİST KYD Ücreti	106.91	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	364,097.99	0.2871 %
TOPLAM:		

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
PETKM	Bedelsiz Sermaye	24/11/20	40,000.00	155,584.33

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	52,261,254.000	57,449,228.68	2,011,898.000	2,211,619.11



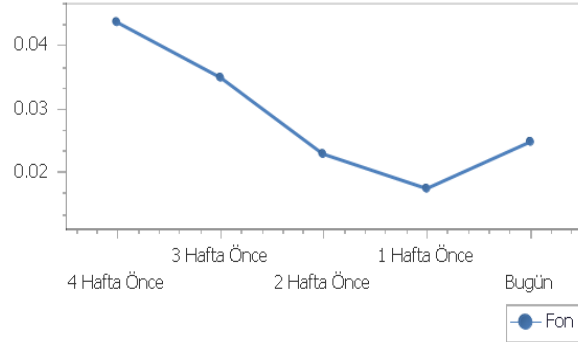
FON RİSK RAPORU

30.11.2020

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon

Fon Bilgileri	
Fon Portföy Değeri	117,064,681.45
Fon Toplam Değeri	126,866,100.79
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.01

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.74	Limit : 10.00

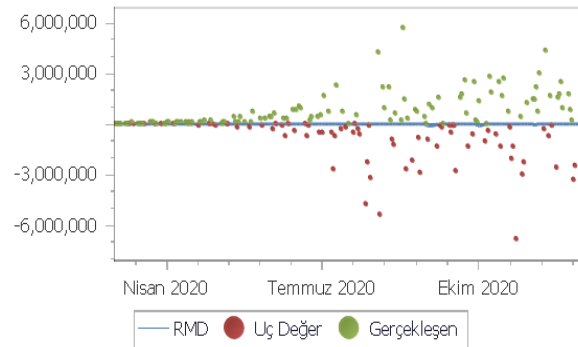
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	31,423.86			
RMD (%)	0.02			5.59
Beklenen Kayıp	36,098.29			
Beklenen Kayıp (%)	0.03			
Uç Değer Adedi	73			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	62,027	84	0.00

Geriye Dönük Test

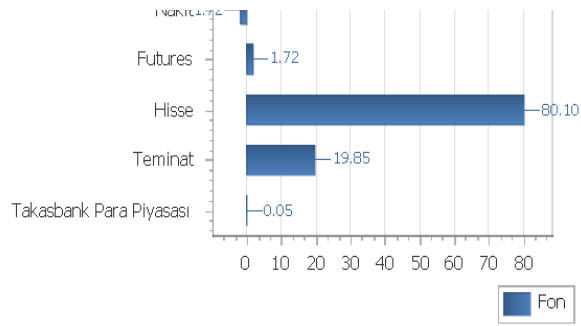


Fon Varlık Kırılımı



Teminat	23,236,815	31,340	0.02
Hisse	93,765,839	-3,240,482	-2.55
Futures	2,013,783	-3,384,689	-2.67
Nakit	-2,013,783	0	0.00

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-93,765,839	-3,384,689	-2.67
F_AKBNK1220	-6,020,000	-371,315	-0.29
F_ARCLK1220	-1,363,000	-52,499	-0.04
F_EKGYO1220	-8,640,000	-508,043	-0.40
F_ENJSA1220	-4,013,280	-145,373	-0.11
F_FROTO1220	-1,940,400	-122,808	-0.10
F_GARAN1220	-13,482,875	-942,957	-0.74
F_GUBRF1220	-8,592,540	-845,667	-0.67
F_ISCTR1220	-103,509	-1,201	0.00
F_KOZAA1220	-451,052	-11,104	-0.01
F_KOZAL1220	-625,380	-11,380	-0.01
F_MGROS1220	-2,438,004	-91,288	-0.07
F_PETKM1220N1	-6,033,600	-382,472	-0.30
F_SASA1220	-738,843	-24,097	-0.02



F_SOKM1220	-3,923,744	-190,201	-0.15
F_TCELL1220	-10,265,280	-467,258	-0.37
F_TKFEN1220	-1,455,000	-46,087	-0.04
F_TOASO1220	-1,416,450	-52,000	-0.04
F_TSKB1220	-4,259,400	-432,864	-0.34
F_TUPRS1220	-7,603,420	-380,487	-0.30
F_ULKER1220	-8,822,280	-386,264	-0.30
F_VAKBN1220	-1,452,800	-69,581	-0.05
F_YKBNK1220	-124,982	-2,479	0.00

Stress Testi

