

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	:	32,536,918.92
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	31,446,653.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.034670
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.024139
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.03
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0.94
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	55.29
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	33.39
f-) TPP	:	0.64
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	10.68
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	10.486
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.61
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		518,700.00	2,951,403.00	10.67
AKBNK		-168,700.00	-959,903.00	-3.47
ARCLK		203,900.00	3,215,503.00	11.62
ARCLK		-126,200.00	-1,990,174.00	-7.19
ASELS		1,000.00	30,180.00	0.11
ASELS		41,000.00	1,237,380.00	4.47
CCOLA		42,700.00	1,730,204.00	6.25
CCOLA		900.00	36,468.00	0.13
ENJSA		57,600.00	467,712.00	1.69

ENJSA	-17,600.00	-142,912.00	-0.52
ENKAI	3,808.00	20,905.92	0.08
ENKAI	-2,688.00	-14,757.12	-0.05
GARAN	415,100.00	3,246,082.00	11.73
GARAN	-215,100.00	-1,682,082.00	-6.08
HALKB	35,000.00	186,200.00	0.67
HALKB	-6,900.00	-36,708.00	-0.13
ISCTR	12,600.00	62,370.00	0.22
KOZAA	17,600.00	212,256.00	0.77
KOZAL	25,700.00	1,904,370.00	6.88
KOZAL	2,300.00	170,430.00	0.62
MGROS	2,900.00	96,976.00	0.35
MGROS	37,100.00	1,240,624.00	4.48
SAHOL	2,200.00	18,260.00	0.07
SAHOL	100.00	830.00	0.00
SASA	79,000.00	805,800.00	2.91
SASA	-36,100.00	-368,220.00	-1.33
TAVHL	1,500.00	30,450.00	0.11
TAVHL	36,000.00	730,800.00	2.64
TCELL	13,200.00	186,912.00	0.68
TCELL	-12,900.00	-182,664.00	-0.66
TKFEN	215,100.00	3,013,551.00	10.89
TKFEN	305,500.00	4,280,055.00	15.46
TUPRS	24,600.00	2,108,220.00	7.62
TUPRS	-19,900.00	-1,705,430.00	-6.16
VAKBN	400,000.00	1,860,000.00	6.72
TOPLAM:	1,889,020.00	22,761,091.80	82.25

TPP

TPP	01/06/20	155,112.75	155,112.75	0.56
TOPLAM:		155,112.75	155,112.75	0.56

VOB Nakit Teminatı

		4,758,467.31	4,758,467.31	17.19
TOPLAM:		4,758,467.31	4,758,467.31	17.19
PORTFÖY DEĞERİ:		6,802,600.06	27,674,671.86	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	27,674,671.86	85.06 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3,597.54	0.01 %
C-)ALACAKLAR	33,778,939.69	103.82 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-28,920,290.17	-88.88 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	32,536,918.92	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	26,431.82	0.0812 %

Fon Yönetim Ücreti	68,384.10	0.2102 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	352.52	0.0011 %
Tescil ve İlan Giderleri	492.70	0.0015 %
Kayda Alma Ücreti		
Portföydeki Varlıkların Saklanması	3,739.85	0.0115 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	375.24	0.0012 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	748.18	0.0023 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	194.81	0.0006 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	14.16	0.0000 %
TOPLAM:	100,733.38	0.3096 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE SENEDİ ALIM, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvanı	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
ENKAI	Bedelsiz Sermaye	29/05/20	408.00	2,236.67

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	98,988.000	101,470.12	20,125,781.000	20,611,597.23



FON RİSK RAPORU

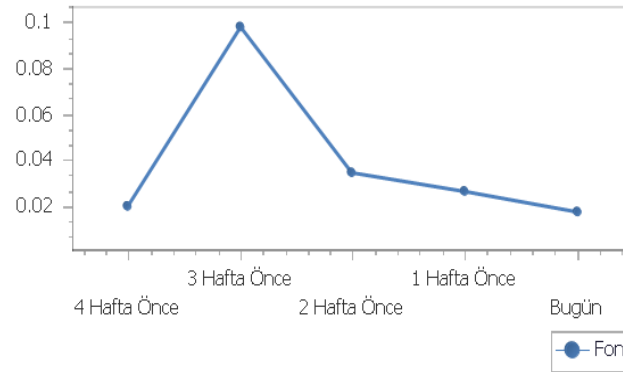
29.05.2020

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	27,674,671.86
Fon Toplam Değeri	32,536,918.92
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.01

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.70	Limit : 10.00

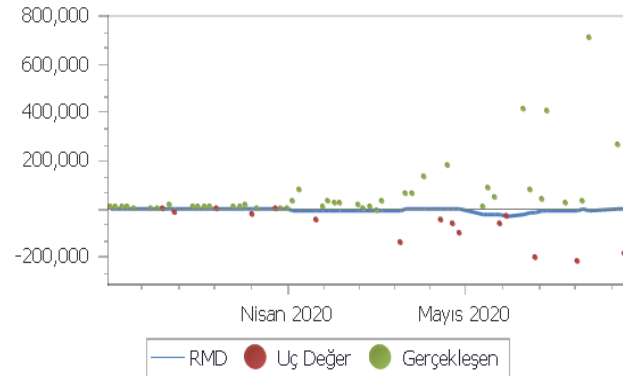
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	5,580.77			
RMD (%)	0.02			5.59
Beklenen Kayıp	6,410.94			
Beklenen Kayıp (%)	0.02			
Uç Değer Adedi	15			

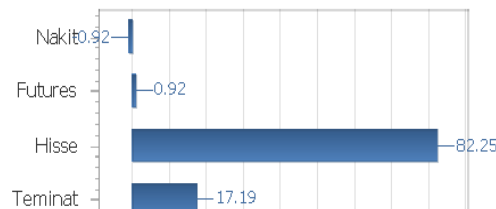
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	155,113	176	0.00
Teminat	4,758,467	5,405	0.02
Hisse	22,761,092	-965,718	-2.97

Geriye Dönük Test



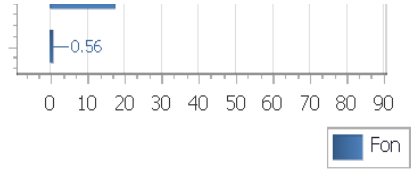
Fon Varlık Kırılımı



Futures	254,215	-1,041,382	-3.20
Nakit	-254,215	0	0.00

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-22,761,092	-1,041,382	-3.20
F_AKBK0620	-1,991,500	-104,400	-0.32
F_ARCLK0620	-1,225,329	-66,398	-0.20
F_ASELS0620	-1,267,560	-78,336	-0.24
F_CCOLA0620	-1,766,672	-102,981	-0.32
F_ENJSA0620	-324,800	-16,467	-0.05
F_ENKAI0620N1	-6,149	-29	0.00
F_GARAN0620	-1,564,000	-93,017	-0.29
F_HALKB0620	-149,492	-4,481	-0.01
F_ISCTR0620	-62,370	-785	0.00
F_KOZAA0620	-212,256	-14,059	-0.04
F_KOZAL0620	-2,074,800	-133,537	-0.41
F_MGROS0620	-1,337,600	-102,102	-0.31
F_SAHOL0620	-19,090	-69	0.00

Takasbank Para Piyasası



F_SASA0620	-437,580	-41,735	-0.13
F_TAVHL0620	-761,250	-61,548	-0.19
F_TCELL0620	-4,248	-18	0.00
F_TKFEN0620	-7,293,606	-406,393	-1.25
F_TUPRS0620	-402,790	-18,428	-0.06
F_VAKBN0620	-1,860,000	-105,407	-0.32

Stress Testi

