DPI-DENIZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
A-2020

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	DPI-DENIZ 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	:	155,281,785.23
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	144,347,702.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.075748
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.063486
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	1.15
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.25
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	68.18
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	9.13
f-) TPP	:	1.81
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.00
k-) Katilim Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	20.88
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	48.416
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0.34
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		1,852,600.00	9,059,214.00	8.48
AKBNK		-52,600.00	-257,214.00	-0.24
ASELS		13,000.00	211,120.00	0.20
ASELS		-12,600.00	-204,624.00	-0.19
BIMAS		39,100.00	2,652,935.00	2.48
BIMAS		-23,600.00	-1,601,260.00	-1.50
CCOLA		29,300.00	1,266,346.00	1.18
CCOLA		6,500.00	280,930.00	0.26
ENKAI		7,500.00	47,925.00	0.05

ENKAI		26,700.00	170,613.00	0.16
EREGL		10,600.00	92,432.00	0.09
EREGL		-10,000.00	-87,200.00	-0.08
GARAN		910,000.00	6,151,600.00	5.75
GARAN		-605,000.00	-4,089,800.00	-3.83
HALKB		126,800.00	622,588.00	0.58
HALKB		-104,400.00	-512,604.00	-0.48
ISCTR		141,800.00	696,238.00	0.65
ISCTR		-115,000.00	-564,650.00	-0.53
KCHOL		93,900.00	1,399,110.00	1.31
KCHOL		150,000.00	2,235,000.00	2.09
KOZAL		35,000.00	2,719,500.00	2.54
KOZAL		-33,400.00	-2,595,180.00	-2.43
MGROS		17,900.00	702,038.00	0.66
MGROS		-17,400.00	-682,428.00	-0.64
SAHOL		4,000.00	30,920.00	0.03
SAHOL		13,800.00	106,674.00	0.10
SODA		1,411,900.00	9,615,039.00	9.00
SODA		-1,132,200.00	-7,710,282.00	-7.21
TAVHL		110,100.00	1,651,500.00	1.54
TAVHL		-109,100.00	-1,636,500.00	-1.53
TCELL		274,000.00	3,923,680.00	3.67
TCELL		726,000.00	10,396,320.00	9.73
TKFEN		629,000.00	9,328,070.00	8.73
TKFEN		-430,800.00	-6,388,764.00	-5.98
TOASO		50,500.00	1,134,230.00	1.06
TOASO		135,100.00	3,034,346.00	2.84
TRKCM		4,054,100.00	15,932,613.00	14.91
TRKCM		-2,854,100.00	-11,216,613.00	-10.49
TTKOM		10,900.00	74,447.00	0.07
TTKOM		65,800.00	449,414.00	0.42
TUPRS		432,400.00	34,592,000.00	32.35
TUPRS		-261,500.00	-20,920,000.00	-19.57
ULKER		144,600.00	3,311,340.00	3.10
ULKER		75,400.00	1,726,660.00	1.61
VAKBN		20,000.00	81,400.00	0.08
YKBNK		50,000.00	101,500.00	0.10
YKBNK		10,700.00	21,721.00	0.02
	TOPLAM:	5,917,300.00	65,352,344.00	61.14
T.REPO				
TRT180123T10	01/09/20	4,152,660.00	4,001,084.93	3.74
TRT280628T18	01/09/20	1,382,970.00	2,000,542.47	1.87
	TOPLAM:	5,535,630.00	6,001,627.40	5.61
TPP				
TPP	01/09/20	276,077.88	276,077.88	0.26
	TOPLAM:	276,077.88	276,077.88	0.26
VOB Nakit Teminatı				
		35,261,801.30	35,261,801.30	32.99
	TOPLAM:	35,261,801.30	35,261,801.30	32.99
PORTFÖY DEĞERİ:		46,990,809.18	106,891,850.58	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	106,891,850.58	68.84 %
B-)HAZIR DEĞERLER	5,518.03	0.00 %
C-)ALACAKLAR	104,185,166.73	67.09 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-55,800,750.11	-35.94 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	155,281,785.23	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	89,557.76	0.0577 %
Fon Yönetim Ücreti	327,409.68	0.2108 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	352.52	0.0002 %
Kayda Alma Ücreti	2,627.08	0.0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	10,576.83	0.0068 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	158.48	0.0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	958.16	0.0006 %
Diğer Harcamalar	-4.84	0.0000 %
BİST KYD Ücreti	920.00	0.0006 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	141.32	0.0001 %
TOPLAM:	432,696.99	0.2786 %

VI-GEÇEN AY IÇINDE RUÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSIZ HISSE SENEDI ALIMI, TEMMETTU VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
ASELS	Bedelsiz Sermaye	07/08/20	240,000.00	4,390,022.37
TTKOM	Temmettü	04/08/20	0.00	687.60

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	9,013,505.000	9,585,736.38	41,165,586.000	43,779,024.39

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon-31.08.2020 Risk Bildirim Tablosu

Fon Portföy Değeri	106,891,850.58	
Fon Toplam Değeri	155,281,785.23	
Risk Değeri	2	
Fon Portföyü Standart Sapması	0.02	

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.42	Limit : 10.00

RMD Özeti

	Fon			Limit

RMD	41,981.97			
RMD (%)	0.03			5.59
Beklenen Kayıp	48,226.97			
Beklenen Kayıp (%)	0.03			
Uç Değer Adedi	46			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	276,078	279	0.00
Teminat	35,261,801	35,637	0.02
Ters Repo	6,001,627	6,065	0.00
Hisse	65,352,344	-2,496,140	-1.61
Futures	732,739	-2,528,919	-1.63
Nakit	-732,739	0	0.00