

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**E-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	:	207,114,425.41
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	190,846,413.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.085241
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.075748
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	0.88
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0.86
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	61.26
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	16.59
f-) TPP	:	0.43
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	4.56
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	17.16
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	63.952
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0.21
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		2,354,500.00	12,125,675.00	8.38
AKBNK		-1,027,300.00	-5,290,595.00	-3.66
GARAN		1,994,200.00	14,158,820.00	9.78
GARAN		928,800.00	6,594,480.00	4.56
HALKB		680,700.00	3,491,991.00	2.41
HALKB		-399,800.00	-2,050,974.00	-1.42
ISCTR		1,139,900.00	6,098,465.00	4.21
ISCTR		-139,900.00	-748,465.00	-0.52

KCHOL		470,300.00	6,899,301.00	4.77
KCHOL		-106,900.00	-1,568,223.00	-1.08
TAVHL		22,200.00	342,102.00	0.24
TAVHL		7,900.00	121,739.00	0.08
TCELL		1,003,700.00	15,256,240.00	10.54
TCELL		205,600.00	3,125,120.00	2.16
TOASO		87,600.00	2,154,960.00	1.49
TOASO		17,600.00	432,960.00	0.30
TUPRS		315,100.00	25,081,960.00	17.35
TUPRS		-227,000.00	-18,069,200.00	-12.48
ULKER		121,500.00	2,777,490.00	1.92
ULKER		-83,400.00	-1,906,524.00	-1.32
VAKBN		2,349,700.00	9,727,758.00	6.72
VAKBN		-1,349,700.00	-5,587,758.00	-3.86
YKBNK		200,000.00	426,000.00	0.29
YKBNK		200,000.00	426,000.00	0.29
TOPLAM:		8,765,300.00	74,019,322.00	51.15

T.REPO

TRT160425T17	01/10/20	7,840,930.00	14,504,767.12	10.02
TRT160425T17	01/10/20	5,407,545.00	10,003,287.67	6.91
TRT210421T14	01/10/20	4,968,315.00	5,501,808.22	3.80
TOPLAM:		18,216,790.00	30,009,863.01	20.73

TPP

TPP	01/10/20	5,019,725.37	5,019,725.37	3.47
TPP	01/10/20	813,279.54	813,279.54	0.56
TOPLAM:		5,833,004.91	5,833,004.91	4.03

VOB Nakit Teminatı

		34,872,772.60	34,872,772.60	24.09
TOPLAM:		34,872,772.60	34,872,772.60	24.09
PORTFÖY DEĞERİ:		67,687,867.51	144,734,962.52	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	144,734,962.52	69.88 %
B-)HAZIR DEĞERLER	4,324.15	0.00 %
C-)ALACAKLAR	137,345,960.17	66.31 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-74,970,821.43	-36.20 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	207,114,425.41	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	468,007.55	0.2260 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu	377.70	0.0002 %
Tescil ve İlan Giderleri		
Kayda Alma Ücreti	5,850.15	0.0028 %

Portföydeki Varlıkların Saklanması	15,087.92	0.0073 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Portföye Alımlarda ve portföyden	76,914.61	0.0371 %
Satımlarda Ödenen Komisyonlar		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	63.06	0.0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına	1,044.46	0.0005 %
Ödenen Denetim Ücreti		
Diğer Harcamalar	10.21	0.0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	83.89	0.0000 %
TOPLAM:	567,439.55	0.2739 %

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

Sirketin Unvanı	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
TKFEN	Temmettū	28/09/20	92,214.38	92,214.38

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	11,099,983.000	11,940,784.51	57,598,694.000	61,961,679.87



FON RİSK RAPORU

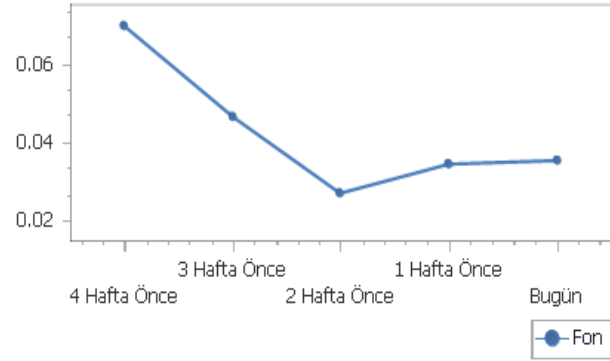
30.09.2020

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	144,734,962.52
Fon Toplam Değeri	207,114,425.41
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.02

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.36	Limit : 10.00

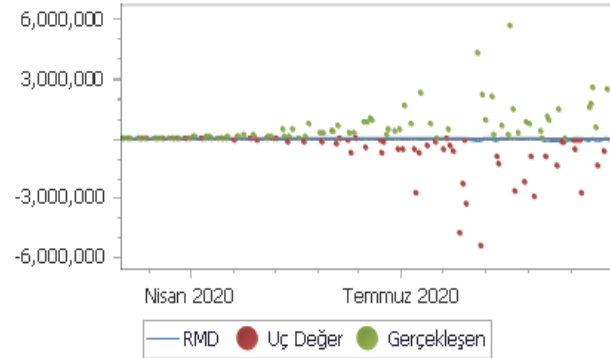
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	72,936.06			
RMD (%)	0.04			5.59
Beklenen Kayıp	83,785.61			
Beklenen Kayıp (%)	0.04			
Uç Değer Adedi	57			

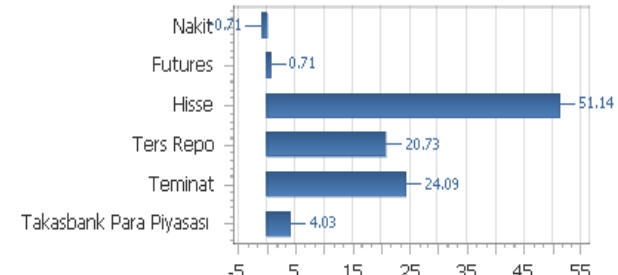
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Takasbank Para Piyasası	5,833,005	6,016	0.00
Teminat	34,872,773	35,966	0.02
Ters Repo	30,009,863	30,950	0.01
Hisse	74,010,232	7,620,015	1.03

Geriye Dönük Test

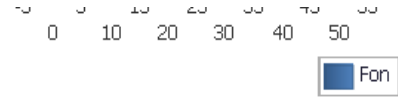


Fon Varlık Kırılımı



Hisse	74,019,322	-2,659,015	-1.27
Futures	1,029,329	-2,656,785	-1.28
Nakit	-1,029,329	0	0.00

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-74,019,322	-2,656,785	-1.28
F_AKBNK1020	-6,835,080	-254,800	-0.12
F_GARAN1020	-20,753,300	-998,311	-0.48
F_HALKB1020	-1,441,017	-30,230	-0.01
F_ISCTR1020	-5,350,000	-177,882	-0.09
F_KCHOL1020	-5,331,078	-174,801	-0.08
F_TAVHL1020	-463,841	-5,094	0.00
F_TCELL1020	-18,381,360	-690,673	-0.33
F_TOASO1020	-2,587,920	-81,115	-0.04
F_TUPRS1020	-7,012,760	-328,941	-0.16
F_ULKER1020	-870,966	-9,800	0.00
F_VAKBN1020	-4,140,000	-149,522	-0.07
F_YKBNK1020	-852,000	-7,288	0.00



Stress Testi

