

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**A-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	:	150,666,683.43
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	131,756,061.000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı	:	1.143528
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı	:	1.119425
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	2.15
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	1.94
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	84.30
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvili	:	0.00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0.00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	1.49
f-) TPP	:	0.65
g-) Opsiyon	:	0.00
h-) Varant	:	0.00
i-)Değerli Maden	:	0.00
j-) Mevduat	:	0.09
k-) Katılım Hesabı	:	0.00
l-)Diğer	:	13.47
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	43.919
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%
MEVDUAT				
Mevduat	04/01/21	341,000.00	341,597.51	1.57
	TOPLAM:	341,000.00	341,597.51	1.57
VOB Nakit Teminatı				
		21,416,497.04	21,416,497.04	98.43
	TOPLAM:	21,416,497.04	21,416,497.04	98.43
PORTFÖY DEĞERİ:		21,757,497.04	21,758,094.55	100.00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

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

A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	21,758,094.55	14.44 %
B-)HAZIR DEĞERLER	8,342.02	0.01 %
C-)ALACAKLAR	150,122,611.78	99.64 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0.00	0.00 %
E-)BORÇLAR	-23,227,212.91	-15.42 %
F-)İHTİYAT	0.00	0.00 %
G-)VERGİ	0.00	0.00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	150,666,683.43	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	382,768.57	0.2540 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	390.29	0.0003 %
Kayda Alma Ücreti	2,292.86	0.0015 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	11,418.06	0.0076 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	2,128.77	0.0014 %
Alınan Kredi Faizleri	94,997.78	0.0631 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	62.15	0.0000 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi	1,060.82	0.0007 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	-5.02	0.0000 %
Diğer Harcamalar	111.06	0.0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	495,225.34	0.3287 %
TOPLAM:		

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
TCELL	Temmettü	02/12/20	671,248.12	671,248.12
AELS	Temmettü	22/12/20	9,893.27	9,893.27

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
TL	5,219,523.000	5,842,864.53	23,644,107.000	26,467,804.48



FON RİSK RAPORU

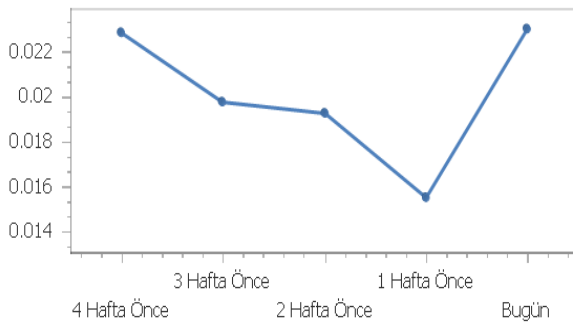
12.31.2020

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	21,758,094.55
Fon Toplam Değeri	150,666,683.43
Risk Değeri	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.07

Fon RMD Trendi



Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	Limit : 10.00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	34,662.04			

Geriye Dönük Test

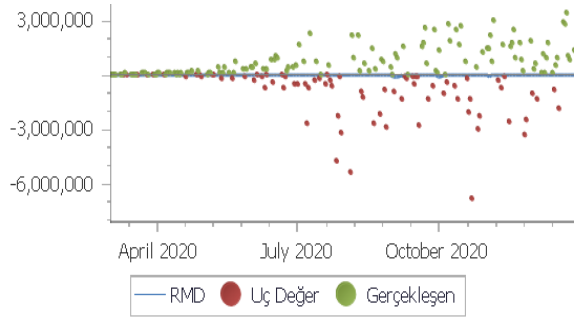


RMD (%)	0.02			5.59
Beklenen Kayıp	39,818.16			
Beklenen Kayıp (%)	0.03			
Uç Değer Adedi	78			

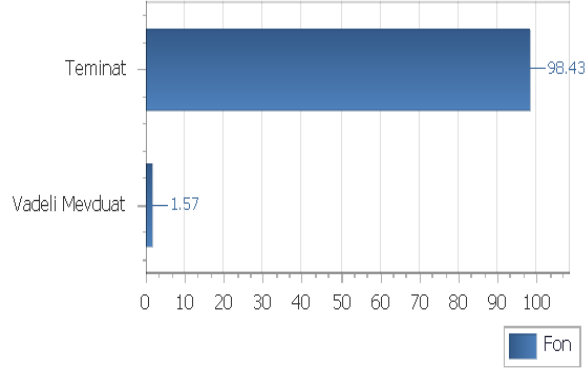
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	341,598	544	0.00
Teminat	21,416,497	34,118	0.02

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
---------------------------	--------------------	-----------	---------------



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

