

**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      | : | 179,819,556.23                                     |
| G-)Tedavüldeki Pay Sayısı | : | 163,580,833.000                                    |
| H-)Fonun Kuruluş Tarihi   | : | 02 Mart 2020                                       |
| I-)Fonun Süresi           | : | Süresizdir.                                        |

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

|                                      |   |          |
|--------------------------------------|---|----------|
| A-)Ay Sonu Pay Fiyatı                | : | 1.099270 |
| B-)Önceki Ay Pay Fiyatı              | : | 1.085241 |
| C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı      | : | 1.29     |
| D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı  | : | 1.16     |
| E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı     | : |          |
| F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi    | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 76.89    |
| b-)Hazine Bonosu                     | : | 0.00     |
| c-)Devlet Tahvili                    | : | 0.00     |
| d-) Özel Sektör Tahvili              | : | 0.00     |
| e-)Devlet Tahvili Repo               | : | 6.61     |
| f-) TPP                              | : | 0.98     |
| g-) Opsiyon                          | : | 0.00     |
| h-) Varant                           | : | 0.00     |
| i-)Değerli Maden                     | : | 0.00     |
| j-) Mevduat                          | : | 0.08     |
| k-) Katılım Hesabı                   | : | 0.00     |
| l-)Diğer                             | : | 15.44    |
| G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı      | : | 55.980   |
| H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 0.23     |
| 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%  |
|------------------------|------|---------------|----------------|--------|
| <b>HİSSE SENETLERİ</b> |      |               |                |        |
| AKBNK                  |      | 100,000.00    | 477,000.00     | 0.37   |
| ARCLK                  |      | 173,400.00    | 4,660,992.00   | 3.59   |
| ARCLK                  |      | 98,300.00     | 2,642,304.00   | 2.03   |
| ASELS                  |      | 1,998,800.00  | 33,479,900.00  | 25.77  |
| ASELS                  |      | -1,998,300.00 | -33,471,525.00 | -25.76 |
| BIMAS                  |      | 41,200.00     | 2,752,160.00   | 2.12   |
| BIMAS                  |      | -41,000.00    | -2,738,800.00  | -2.11  |
| CCOLA                  |      | 22,300.00     | 1,001,270.00   | 0.77   |
| CCOLA                  |      | 57,700.00     | 2,590,730.00   | 1.99   |

|       |         |               |                |        |
|-------|---------|---------------|----------------|--------|
| ENJSA |         | 102,100.00    | 917,879.00     | 0.71   |
| ENJSA |         | -28,200.00    | -253,518.00    | -0.20  |
| ENKAI |         | 19,400.00     | 139,874.00     | 0.11   |
| ENKAI |         | -18,400.00    | -132,664.00    | -0.10  |
| GUBRF |         | 72,900.00     | 2,430,486.00   | 1.87   |
| GUBRF |         | -71,900.00    | -2,397,146.00  | -1.85  |
| ISCTR |         | 40,000.00     | 204,400.00     | 0.16   |
| ISCTR |         | 360,000.00    | 1,839,600.00   | 1.42   |
| KCHOL |         | 276,900.00    | 3,920,904.00   | 3.02   |
| KCHOL |         | 323,100.00    | 4,575,096.00   | 3.52   |
| KOZAL |         | 50,700.00     | 3,731,520.00   | 2.87   |
| KOZAL |         | 23,800.00     | 1,751,680.00   | 1.35   |
| MGROS |         | 700.00        | 26,222.00      | 0.02   |
| MGROS |         | 30,400.00     | 1,138,784.00   | 0.88   |
| OYAKC |         | 31,700.00     | 232,678.00     | 0.18   |
| OYAKC |         | -21,700.00    | -159,278.00    | -0.12  |
| SASA  |         | 261,400.00    | 3,999,420.00   | 3.08   |
| SASA  |         | 238,600.00    | 3,650,580.00   | 2.81   |
| SISE  |         | 1,210,000.00  | 7,417,300.00   | 5.71   |
| SISE  |         | 2,190,000.00  | 13,424,700.00  | 10.33  |
| SOKM  |         | 424,600.00    | 4,814,964.00   | 3.71   |
| SOKM  |         | -158,500.00   | -1,797,390.00  | -1.38  |
| TCELL |         | 2,319,000.00  | 33,857,400.00  | 26.04  |
| TCELL |         | -1,378,800.00 | -20,130,480.00 | -15.50 |
| TKFEN |         | 2,700.00      | 35,829.00      | 0.03   |
| TKFEN |         | 55,100.00     | 731,177.00     | 0.56   |
| TOASO |         | 167,600.00    | 4,478,272.00   | 3.45   |
| TOASO |         | 500.00        | 13,360.00      | 0.01   |
| TUPRS |         | 55,200.00     | 4,126,200.00   | 3.18   |
| TUPRS |         | -55,000.00    | -4,111,250.00  | -3.16  |
| ULKER |         | 46,200.00     | 934,164.00     | 0.72   |
| ULKER |         | 81,600.00     | 1,649,952.00   | 1.27   |
| VESTL |         | 76,300.00     | 1,264,291.00   | 0.97   |
| VESTL |         | -19,500.00    | -323,115.00    | -0.25  |
| YKBNK |         | 640,000.00    | 1,376,000.00   | 1.06   |
| YKBNK |         | -463,400.00   | -996,310.00    | -0.77  |
|       | TOPLAM: | 7,337,500.00  | 83,775,612.00  | 64.48  |

#### T.REPO

|              |          |               |               |      |
|--------------|----------|---------------|---------------|------|
| TRT210623T10 | 02/11/20 | 10,241,115.00 | 10,012,123.29 | 7.71 |
|              | TOPLAM:  | 10,241,115.00 | 10,012,123.29 | 7.71 |

#### TPP

|     |          |            |            |      |
|-----|----------|------------|------------|------|
| TPP | 02/11/20 | 921,069.97 | 921,069.97 | 0.71 |
|     | TOPLAM:  | 921,069.97 | 921,069.97 | 0.71 |

#### VOB Nakit Teminatı

|                 |         |               |                |        |
|-----------------|---------|---------------|----------------|--------|
|                 |         | 35,211,122.35 | 35,211,122.35  | 27.10  |
|                 | TOPLAM: | 35,211,122.35 | 35,211,122.35  | 27.10  |
| PORTFÖY DEĞERİ: |         | 53,710,807.32 | 129,919,927.61 | 100.00 |

#### IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

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

|                       |                |          |
|-----------------------|----------------|----------|
| A-)FON PORTFÖY DEĞERİ | 129,919,927.61 | 72.25 %  |
| B-)HAZIR DEĞERLER     | 3,601.40       | 0.00 %   |
| C-)ALACAKLAR          | 139,887,769.78 | 77.79 %  |
| D-)DİĞER VARLIKLAR    | 0.00           | 0.00 %   |
| E-)BORÇLAR            | -89,991,742.56 | -50.05 % |
| F-)İHTİYAT            | 0.00           | 0.00 %   |
| G-)VERGİ              | 0.00           | 0.00 %   |
| FON TOPLAM DEĞERİ     | 179,819,556.23 | 100,00 % |

#### V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| AÇIKLAMA                           | TUTAR      | ORAN%    |
|------------------------------------|------------|----------|
| Fon Yönetim Ücreti                 | 445,867.82 | 0.2480 % |
| Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu   | 402.88     | 0.0002 % |
| Tescil ve İlan Giderleri           |            |          |
| Kayda Alma Ücreti                  | 3,230.80   | 0.0018 % |
| Portföydeki Varlıkların Saklanması | 13,970.83  | 0.0078 % |
| Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler    |            |          |
| Portföye Alımlarda ve portföyden   | 98,200.05  | 0.0546 % |
| Satımlarda Ödenen Komisyonlar      |            |          |
| Fonun Mükellefi Olduğu Vergi       | 62.57      | 0.0000 % |
| Ödemeleri                          |            |          |
| Bağımsız Denetim Kuruluşlarına     | 1,095.04   | 0.0006 % |
| Ödenen Denetim Ücreti              |            |          |
| Diğer Harcamalar                   | 1.65       | 0.0000 % |
| BİST KYD Ücreti                    | 494.00     | 0.0003 % |
| Otomatik BPP Faiz BSMV             | 199.29     | 0.0001 % |
| TOPLAM:                            | 563,524.93 | 0.3134 % |

#### 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      |
|-----------------|------------|----------------|----------------|------------|
| ASELS           | Temmettü   | 20/10/20       | 121,089.75     | 121,089.75 |

#### VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

| Döviz Cinsi | Alış Miktarı   | Alış Tutarı   | Satış Miktarı  | Satış Tutarı  |
|-------------|----------------|---------------|----------------|---------------|
| TL          | 45,775,615.000 | 49,677,574.20 | 18,510,035.000 | 20,087,848.89 |

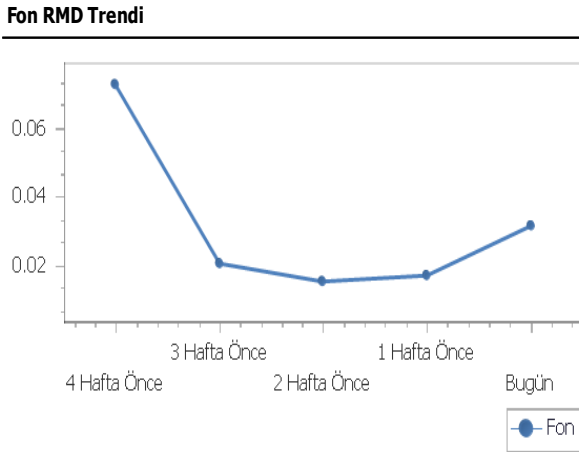


#### FON RİSK RAPORU

30.10.2020

#### DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon

| Fon Bilgileri                      | Fon RMD Trendi |
|------------------------------------|----------------|
| Fon Portföy Değeri                 | 129,919,927.61 |
| Fon Toplam Değeri                  | 179,819,556.23 |
| Risk Değeri                        | 2              |
| Fon Portföyü Standart Sapması      | 0.02           |
| Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi |                |
| Açık Pozisyon Tutarı               | 0.00           |
| Limit : 1.00                       |                |
| Kaldıraç Oranı                     | 0.47           |
| Limit : 10.00                      |                |



#### Geriye Dönük Test

| RMD Özeti | Fon       | Kıstas | Görelî | Limit |
|-----------|-----------|--------|--------|-------|
| RMD       | 56.657.13 |        |        |       |

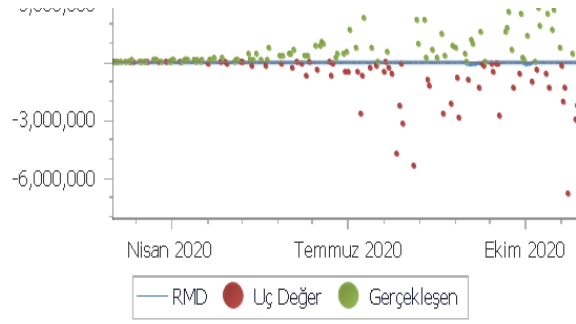


|                    |           |  |  |      |
|--------------------|-----------|--|--|------|
| RMD                | 0.03      |  |  | 5.59 |
| Beklenen Kayıp     | 65,085.12 |  |  |      |
| Beklenen Kayıp (%) | 0.04      |  |  |      |
| Uç Değer Adedi     | 67        |  |  |      |

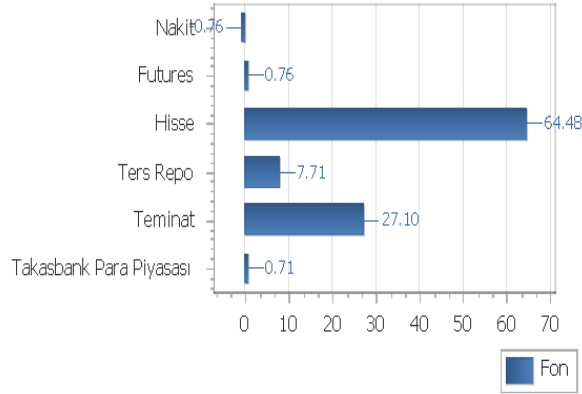
#### RMD Kırılımı

| Piyasa                  | Büyüklik   | Artık RMD  | Artık RMD (%) |
|-------------------------|------------|------------|---------------|
| Takasbank Para Piyasası | 921,070    | 1,131      | 0.00          |
| Teminat                 | 35,211,122 | 43,232     | 0.02          |
| Ters Repo               | 10,012,123 | 12,292     | 0.01          |
| Hisse                   | 83,775,612 | -2,802,220 | -1.56         |
| Futures                 | 983,604    | -2,848,752 | -1.58         |
| Nakit                   | -983,604   | 0          | 0.00          |

| Kaldıraç Yaratıcı İşlemler | Sözleşme Büyüklüğü | Artık RMD  | Artık RMD (%) |
|----------------------------|--------------------|------------|---------------|
| Toplam                     | -83,775,612        | -2,848,752 | -1.58         |
| F_AKBK1120                 | -477,000           | -2,292     | 0.00          |
| F_ARCLK1120                | -7,303,296         | -372,978   | -0.21         |
| F_ASELS1120                | -8,375             | 41         | 0.00          |
| F_BIMAS1120                | -13,360            | 73         | 0.00          |
| F_CCOLA1120                | -3,592,000         | -152,759   | -0.08         |
| F_ENJSA1120                | -664,361           | -4,889     | 0.00          |
| F_ENKAI1120                | -7,210             | -12        | 0.00          |



#### Fon Varlık Kırılımı



|             |             |            |       |
|-------------|-------------|------------|-------|
|             |             |            |       |
| F_GUBRF1120 | -33,340     | -229       | 0.00  |
| F_ISCTR1120 | -2,044,000  | -56,924    | -0.03 |
| F_KCHOL1120 | -8,496,000  | -296,786   | -0.17 |
| F_KOZAL1120 | -5,483,200  | -169,405   | -0.09 |
| F_MGROS1120 | -1,165,006  | -24,049    | -0.01 |
| F_OYAKC1120 | -73,400     | 15         | 0.00  |
| F_SASA1120  | -7,650,000  | -464,470   | -0.26 |
| F_SISE1120  | -20,842,000 | -1,309,826 | -0.73 |
| F_SOKM1120  | -3,017,574  | -107,607   | -0.06 |
| F_TCELL1120 | -13,726,920 | -578,808   | -0.32 |
| F_TKFEN1120 | -767,006    | -8,562     | 0.00  |
| F_TOASO1120 | -4,491,632  | -190,483   | -0.11 |
| F_TUPRS1120 | -14,950     | 66         | 0.00  |
| F_ULKER1120 | -2,584,116  | -70,661    | -0.04 |
| F_VESTL1120 | -941,176    | -14,424    | -0.01 |
| F_YKBNK1120 | -379,690    | -3,252     | 0.00  |

Stress Testi

