

**DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON****O-2021****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      | : | 202,446,513.57                                     |
| G-)Tedavüldeki Pay Sayısı | : | 174,228,825.000                                    |
| H-)Fonun Kuruluş Tarihi   | : | 02 Mart 2020                                       |
| I-)Fonun Süresi           | : | Süresizdir.                                        |

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

|                                      |   |          |
|--------------------------------------|---|----------|
| A-)Ay Sonu Pay Fiyatı                | : | 1.161958 |
| B-)Önceki Ay Pay Fiyatı              | : | 1.143528 |
| C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı      | : | 1.61     |
| D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı  | : | 1.61     |
| E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı     | : |          |
| F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi    | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 72.98    |
| b-)Hazine Bonosu                     | : | 0.00     |
| c-)Devlet Tahvili                    | : | 0.00     |
| d-) Özel Sektör Tahvili              | : | 0.00     |
| e-)Devlet Tahvili Repo               | : | 10.60    |
| f-) TPP                              | : | 0.58     |
| g-) Opsiyon                          | : | 0.00     |
| h-) Varant                           | : | 0.00     |
| i-)Değerli Maden                     | : | 0.00     |
| j-) Mevduat                          | : | 0.72     |
| k-) Katılım Hesabı                   | : | 0.00     |
| l-)Diğer                             | : | 15.12    |
| G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı      | : | 58.076   |
| H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı | : |          |
| a-)Hisse Senedi                      | : | 0.30     |
| 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> |          |               |               |       |
| SASA                   |          | 315,300.00    | 8,071,680.00  | 7.26  |
| SASA                   |          | -150,200.00   | -3,845,120.00 | -3.46 |
|                        | TOPLAM:  | 165,100.00    | 4,226,560.00  | 3.80  |
| <b>T.REPO</b>          |          |               |               |       |
| TRT140126T11           | 01/02/21 | 27,911,660.00 | 50,069,863.02 | 45.01 |
| TRT230222T13           | 01/02/21 | 4,023,845.00  | 10,013,972.60 | 9.00  |
|                        | TOPLAM:  | 31,935,505.00 | 60,083,835.62 | 54.01 |
| <b>TPP</b>             |          |               |               |       |
| TPP                    | 01/02/21 | 9,012,575.34  | 9,012,575.34  | 8.10  |

|         |          |              |              |      |
|---------|----------|--------------|--------------|------|
| TPP     | 01/02/21 | 541,758.14   | 541,758.14   | 0.49 |
| TOPLAM: |          | 9,554,333.48 | 9,554,333.48 | 8.59 |

#### VOB Nakit Teminatı

|                 |               |                |        |
|-----------------|---------------|----------------|--------|
|                 | 37,371,055.26 | 37,371,055.26  | 33.60  |
| TOPLAM:         | 37,371,055.26 | 37,371,055.26  | 33.60  |
| PORTFÖY DEĞERİ: | 79,025,993.74 | 111,235,784.36 | 100.00 |

#### IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

| AÇIKLAMA              | TUTAR          | ORAN%    |
|-----------------------|----------------|----------|
| A-)FON PORTFÖY DEĞERİ | 111,235,784.36 | 54.95 %  |
| B-)HAZIR DEĞERLER     | 8,786.49       | 0.00 %   |
| C-)ALACAKLAR          | 103,592,051.19 | 51.17 %  |
| D-)DİĞER VARLIKLAR    | 0.00           | 0.00 %   |
| E-)BORÇLAR            | -12,390,108.47 | -6.12 %  |
| F-)İHTİYAT            | 0.00           | 0.00 %   |
| G-)VERGİ              | 0.00           | 0.00 %   |
| FON TOPLAM DEĞERİ     | 202,446,513.57 | 100,00 % |

#### V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| AÇIKLAMA                           | TUTAR      | ORAN%    |
|------------------------------------|------------|----------|
| Fon Yönetim Ücreti                 | 424,064.20 | 0.2095 % |
| Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu   | 352.52     | 0.0002 % |
| Tescil ve İlan Giderleri           | 3,204.49   | 0.0016 % |
| Kayda Alma Ücreti                  | 13,304.94  | 0.0066 % |
| Portföydeki Varlıkların Saklanması | 3.01       | 0.0000 % |
| Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler    | 118,433.53 | 0.0585 % |
| Alınan Kredi Faizleri              | 69.34      | 0.0000 % |
| Portföye Alımlarda ve portföyden   | 978.39     | 0.0005 % |
| Satımlarda Ödenen Komisyonlar      | -1.52      | 0.0000 % |
| Fonun Mükellefi Olduğu Vergi       | 78.40      | 0.0000 % |
| Ödenen Denetim Kuruluşlarına       |            |          |
| Ödenen Denetim Ücreti              |            |          |
| Diğer Harcamalar                   |            |          |
| Otomatik BPP Faiz BSMV             |            |          |
| TOPLAM:                            | 560,487.30 | 0.2769 % |

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

| Sirketin Unvani | İşlem Tipi | BDL-BDZ Tarihi | Nominal Değeri | TUTAR |
|-----------------|------------|----------------|----------------|-------|
|-----------------|------------|----------------|----------------|-------|

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

| Döviz Cinsi | Alış Miktarı  | Alış Tutarı  | Satış Miktarı  | Satış Tutarı  |
|-------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| TL          | 2,013,689.000 | 2,302,709.75 | 44,486,453.000 | 50,871,504.63 |



#### FON RİSK RAPORU

29.01.2021

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

##### Fon Bilgileri

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| Fon Portföy Değeri            | 111,235,784.36 |
| Fon Toplam Değeri             | 202,446,513.57 |
| Risk Değeri                   | 2              |
| Fon Portföyü Standart Sapması | 0.07           |

##### Fon RMD Trendi



### Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

|                      |      |               |
|----------------------|------|---------------|
| Açık Pozisyon Tutarı | 0.00 | Limit : 1.00  |
| Kaldıraç Oranı       | 0.02 | Limit : 10.00 |

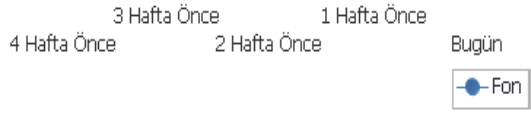
### RMD Özeti

|                    | Fon        | Kıstas | Görelî | Limit |
|--------------------|------------|--------|--------|-------|
| RMD                | 177,377.51 |        |        |       |
| RMD (%)            | 0.09       |        |        | 5.59  |
| Beklenen Kayıp     | 203,763.18 |        |        |       |
| Beklenen Kayıp (%) | 0.10       |        |        |       |
| Uç Değer Adedi     | 86         |        |        |       |

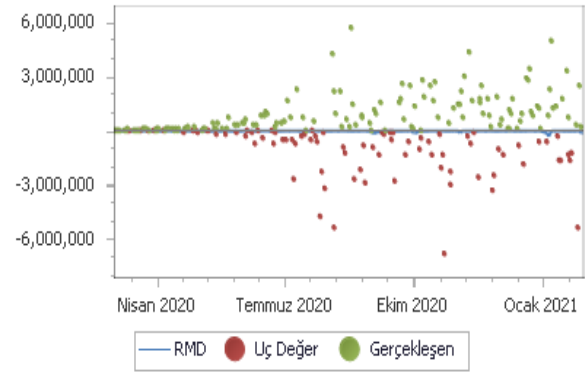
### RMD Kırılımı

| Piyasa                  | Büyüklik   | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|-------------------------|------------|-----------|---------------|
| Takasbank Para Piyasası | 9,554,333  | 15,837    | 0.01          |
| Teminat                 | 37,371,055 | 61,945    | 0.03          |
| Ters Repo               | 60,083,836 | 99,592    | 0.05          |
| Hisse                   | 4,226,560  | -173,988  | -0.09         |
| Futures                 | 66,040     | -218,711  | -0.11         |
| Nakit                   | -66,040    | 0         | 0.00          |

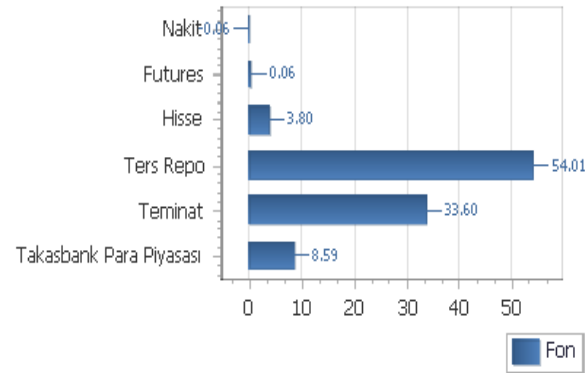
| Kaldıraç Yaratıcı İşlemler | Sözleşme Büyükliğı | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|----------------------------|--------------------|-----------|---------------|
| Toplam                     | -4,226,560         | -218,711  | -0.11         |
| F_SASA0221                 | -4,226,560         | -218,711  | -0.11         |



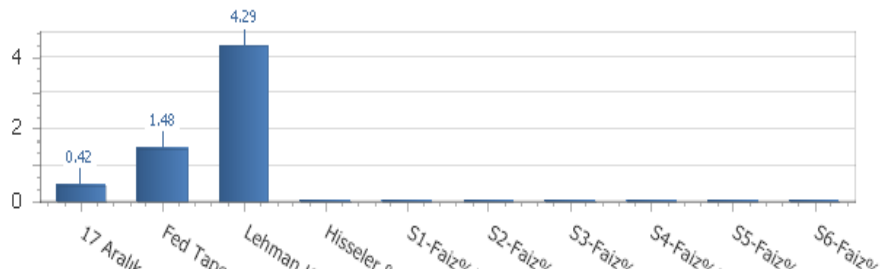
### Geriyeye Dönük Test



### Fon Varlık Kırılımı



### Stress Testi



Ek Akabi

Merkez ve Gezi

Krizi

%10 düşüş, Faiz 100 bps artış, TL %10 değer kaybı

%5 Döviz%20 Hisse%-15 Altın%10 Petrol %-15

%10 Döviz%30 Hisse%-25 Altın%20 Petrol %-25

%15 Döviz%45 Hisse%-35 Altın%30 Petrol %-35

%20 Döviz%60 Hisse%-50 Altın%40 Petrol %-50

%20 Döviz%60 Hisse%-50 Altın%40 Petrol %-50

%20 Döviz%60 Hisse%-50 Altın%40 Petrol %-50

%20 Döviz%60 Hisse%-50 Altın%40 Petrol %-50

%20 Döviz%60 Hisse%-50 Altın%40 Petrol %-50

%20 Döviz%60 Hisse%-50 Altın%40 Petrol %-50

%20 Döviz%60 Hisse%-50 Altın%40 Petrol %-50