

(ESKİ ŞEKİL)

**DENİZBANK A.Ş. A TİPİ İMKB ULUSAL 100 ENDEKSİ FONU**

**İÇTÜZÜĞÜ**

**MADDE 1- FONUN KURULUŞ AMACI:**

- 1.1. DENİZBANK A.Ş. tarafından 3794 sayılı Kanunla değişik 2499 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun 37 ve 38'inci maddelerine dayanılarak ve bu içtüzük hükümlerine göre yönetilmek üzere halktan katılma belgeleri karşılığı toplanacak paralarla, katılma belgesi sahipleri hesabına, riskin dağıtılması ilkesi ve inanca bağlı mülkiyet esaslarına göre sermaye piyasası araçlarından oluşan portföyü işletmek amacıyla "DENİZBANK A.Ş. A TİPİ İMKB ULUSAL 100 ENDEKSİ FONU" kurulmuştur.
- 1.2. Bu içtüzükte Denizbank A.Ş. "KURUCU", Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. "YÖNETİCİ", İMKB Takas ve Saklama Bankası A.Ş. "SAKLAYICI KURULUŞ", Denizbank A.Ş. A Tipi İMKB Ulusal 100 Endeksi Fonu "FON", Sermaye Piyasası Kurulu'nun Seri VII, No:10 Yatırım Fonlarına İlişkin Esaslar Tebliği ise "TEBLİĞ" olarak ifade edilecektir.

**MADDE 2 – Fon'un Adı ile Kurucu, Yönetici ve Saklayıcı Kuruluş'un Ünvan ve Merkez Adresleri :**

- 2.1. Fonun Adı; "Denizbank A.Ş. A Tipi İMKB Ulusal 100 Endeksi Fonu"dur.  
Fon'un Yönetim Adresi : Büyükdere Cad. No:106 Esentepe 34394 İstanbul

**MADDE 5 – Fon Yönetimine İlişkin Esaslar ve Yöneticinin Tabi Olduğu İlkeler :**

- 5.1. Fonun, riskin dağıtılması ve inanca bağlı mülkiyet esaslarına göre katılma belgesi sahiplerinin haklarını koruyacak şekilde yönetim, temsil ve varlıkların saklanması Sermaye Piyasası Kanunu uyarınca Denizbank A.Ş. sorumludur. Fon portföyü yönetici Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından, Sermaye Piyasası Kurulu düzenlemelerine uygun olarak yapılacak bir portföy yönetim sözleşmesi çerçevesinde bu içtüzük ve Tebliğ hükümleri dahilinde yönetilir.

**MADDE 7 – Fonun Yönetim Stratejisi :**

Portföyünün %80'i devamlı olarak Tebliğ'in 3 nolu ekinde yer alan formüle uygun olarak yapılan hesaplama çerçevesinde, baz alınan ve Kurul tarafından uygun görülen bir endeksin değeri ile fonun birim pay değeri arasındaki korelasyon katsayısı en az %90 olacak şekilde, endeks kapsamındaki menkul kıymetlerin tümünden ya da örnekleme yoluyla seçilen bir kısımdan oluşan fonlar ENDEKS FON olarak adlandırılmaktadır. Fon yönetiminde yatırım yapılacak sermaye piyasası araçları bu içtüzüğün 13. maddesinde yer alan formüle uygun olarak yapılan hesaplama çerçevesinde baz alınan endeksin değeri ile fonun birim pay değeri arasındaki korelasyon katsayısı en az %90 olacak şekilde, endeks kapsamındaki menkul kıymetlerden örnekleme yoluyla seçilir. Baz alınan endeks hesaplanma döneminde temettüyü dikkate almayan İMKB Ulusal 100 fiyat endeksidir. Fon portföyünün en az %80'i devamlı olarak baz alınan endeks olan İMKB Ulusal 100 endeksi kapsamındaki menkul kıymetlere yatırılır. Korelasyon katsayısı aysonları itibarıyla son 3 aylık dönemlerde hesaplanır ve Fon'un tasfiyesinde Kurul düzenlemeleri çerçevesinde hesaplanan korelasyon katsayısı esas alınır.

**MADDE 8- FON'UN YATIRIM YAPACAĞI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARININ SEÇİMİ VE RİSKİN DAĞITILMASI ESASLARI:**

- 8.6. Kurucunun , yöneticinin ve bunların doğrudan ve dolaylı iştiraklerinin fonlarının katılma belgeleri ile ortağı oldukları yatırım ortaklarının hisse senetleri hariç olmak üzere farklı türlerdeki diğer fonların katılma belgeleri ve yatırım ortaklıklarının hisse senetleri fon portföyünün % 10'una kadar portföye alınabilir.
- 8.7. Fonun likiditesini sağlamak amacıyla fon portföy değerinin % 5 'ine karşılık gelen bir değer nakit olarak tutulabilir. Belirtilen sınır dahilinde Fon nakdi Borsa Para Piyasası'nda da değerlendirilebilir. Fon bankalar nezdinde vadeli mevduat tutamaz, mevduat sertifikası ile yabancı yatırım ortaklıklarının hisse senetleri ve yatırım fonlarının katılma belgelerini satın alamaz.

- 8.11.** Fon portföy degerinin aylık agirlikli ortalama bazda en az % 80'i devamlı olarak mevzuata göre özelleştirme kapsamına alınan kamu iktisadi tesebbüsleri dahil Türkiye'de kurulmuş ortaklıkların hisse senetlerine yatırılır.

**MADDE 11 – Fon'la İlgili Bilgilerin Açıklanma Şekli :**

- 11.1.** Kurucu her hesap döneminin bitiminden itibaren 3 ay içinde Fon'un, bir önceki yılla karşılaştırmalı olarak hazırlanmış bağımsız denetimden geçmiş fon bilanço ve gelir tabloları, fon portföy değeri ve fon toplam değeri tablolarını ve dönem içindeki gelişmeleri takip eden 3 ay içinde, Bağımsız Denetim Raporu ile birlikte Sermaye Piyasası Kurulu'na gönderir. Ayrıca, bunların bir özetini de Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenecek esaslara göre ilan eder.
- 11.2.** İlgili mevzuatın Ticaret Sicili'ne tescilini öngördüğü diğer hususlar Fon tarafından Türkiye Ticaret Sicili Gazetesi ile Türkiye çapında yayın yapan en az iki gazetede ilan ile duyurulur. Fon ile ilgili bilgilerin açıklanmasında, ayrıca diğer yayın organlarından yararlanılabilir.
- 11.3.** Kurucu, her ayı takip eden 15 gün içinde, ay içindeki menkul kıymet ve katılma belgesi hareketleri ile fon performansına ilişkin bilgileri içerecek şekilde hazırlanan aylık raporların birer örneğini Sermaye Piyasası Kurulu'na gönderir. Ayrıca bu raporlarda son bir ay ve son üç aylık dönemler itibarıyla hesaplanan korelasyon katsayısına yer verilir. Söz konusu raporlar aynı zamanda kurucu merkezinde ve katılma belgesi satışı yapılan yerlerde yatırımcıların incelemesine sunulur. İlgili aya ilişkin alım satım detaylarına yatırımcıya sunulacak aylık rapor nüshalarında yer verilemez.

(YENİ ŞEKİL)

**DENİZBANK A.Ş. A TİPİ İMKB ULUSAL 100 ENDEKSİ FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)**

**İÇTÜZÜĞÜ**

**MADDE 1- FONUN KURULUŞ AMACI:**

**1.1.** Denizbank A.Ş. tarafından 2499 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun 37 ve 38'inci maddelerine dayanılarak ve bu içtüzük hükümlerine göre yönetilmek üzere halktan katılma belgeleri karşılığı toplanacak paralarla, katılma belgeleri sahipleri hesabına, riskin dağıtılması ve inanca dayalı mülkiyet esaslarına göre sermaye piyasası araçlarından oluşan portföyü işletmek amacıyla Denizbank A.Ş. A Tipi İmkb Ulusal 100 Endeksi Fonu kurulmuştur. Fon'un unvanı Sermaye Piyasası Kurulu'nun **05/07/2012 tarih ve B.02.06.SPK.0.15-615** sayılı izni ile Denizbank A.Ş. A Tipi İMKB Ulusal 100 Endeksi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) olarak değiştirilmiştir.

**1.2.** Bu içtüzükte Denizbank A.Ş. "KURUCU", Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. "YÖNETİCİ", İ.M.K.B. Takas ve Saklama Bankası A.Ş. "SAKLAYICI KURULUŞ", Denizbank A.Ş. A Tipi İmkb Ulusal 100 Endeksi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) "FON", Sermaye Piyasası Kurulu'nun Seri:VII, No:10 sayılı Yatırım Fonlarına İlişkin Esaslar Tebliği ile ek ve değişiklikleri ise "TEBLİĞ" olarak ifade edilecektir.

**MADDE 2 – FON'UN ADI İLE KURUCU, YÖNETİCİ VE SAKLAYICI KURULUŞ'UN ÜNVAN VE MERKEZ ADRESLERİ:**

**2.2.** Fonun Adı; "Denizbank A.Ş. A Tipi İMKB Ulusal 100 Endeksi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)"dur.

Fon'un Yönetim Adresi : Büyükdere Cad.Şemsir İş Merkezi No:108/B Kat:8 Esentepe 34394 İstanbul

**MADDE 5 – FON YÖNETİMİNE İLİŞKİN ESASLAR VE YÖNETİCİNİN TABİ OLDUĞU İLKELER:**

**5.1.** Fon'un, riskin dağıtılması ve inanca dayalı mülkiyet esaslarına göre katılma belgesi sahiplerinin haklarını koruyacak şekilde yönetim, temsil ve varlıkların saklanması Sermaye Piyasası Kanunu uyarınca Denizbank A.Ş. sorumludur. Denizbank A.Ş. ayrıca, ilgili ay sonu itibariyle, Fon'un hisse senedi yoğun fon olarak sınıflandırılabilmesi için gerekli olan şartları sağlamaması halinde, Fon'un, yatırımcıların ve tabi olacağı tüm yükümlülüklerin yerine getirilmesinden sorumludur.

Fon portföyü Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından, Sermaye Piyasası Kurulu düzenlemelerine uygun olarak yapılacak bir portföy yönetim sözleşmesi çerçevesinde bu içtüzük ve Tebliğ hükümleri dahilinde yönetilir.

**MADDE 7 – FONUN YÖNETİM STRATEJİSİ:**

Portföyünün %80'i devamlı olarak Tebliğ'in 3 nolu ekinde yer alan formüle uygun olarak yapılan hesaplama çerçevesinde, baz alınan ve Kurul tarafından uygun görülen bir endeksin değeri ile fonun birim pay değeri arasındaki korelasyon katsayısı en az %90 olacak şekilde, endeks kapsamındaki menkul kıymetlerin tümünden ya da örnekleme yoluyla seçilen bir kısmından oluşan fonlar ENDEKS FON olarak adlandırılmaktadır. Fon yönetiminde yatırım yapılacak sermaye piyasası araçları bu içtüzüğün 13. maddesinde yer alan formüle uygun olarak yapılan hesaplama çerçevesinde baz alınan endeksin değeri ile fonun birim pay değeri arasındaki korelasyon katsayısı en az %90 olacak şekilde, endeks kapsamındaki menkul kıymetlerden örnekleme yoluyla seçilir. Baz alınan endeks hesaplanma döneminde temettüyü dikkate almayan İMKB Ulusal 100 fiyat endeksidir. Fon portföyünün en az %80'i devamlı olarak baz alınan endeks olan İMKB Ulusal 100 endeksi kapsamındaki menkul kıymetlere yatırılır. Korelasyon katsayısı aysonları itibariyle son 3 aylık dönemlerde hesaplanır ve Fon'un tasfiyesinde Kurul düzenlemeleri çerçevesinde hesaplanan korelasyon katsayısı esas alınır.

Bu kapsamda, fonun hisse senedi yoğun fon olması nedeniyle, fon portföy değeri, aylık ortalama bazda en az % 75 oranında, menkul kıymet yatırım ortaklıkları hisse senetleri hariç olmak üzere İMKB'de işlem gören hisse

senetlerinden oluşacaktır. Fon portföyünde yer alan hisse senetlerine ve hisse senedi endekslerine dayalı olarak yapılan vadeli işlem sözleşmelerinin nakit teminatları, hisse senetlerine ve hisse senedi endekslerine dayalı opsiyon sözleşmeleri ile borsada işlem gören hisse senedi ve hisse senedi endeksine dayalı aracı kuruluş varantları söz konusu %75 oranının hesaplanmasında hisse senedi olarak değerlendirilir.

#### **MADDE 8- FON'UN YATIRIM YAPACAĞI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARININ SECİMİ VE RİSKİN DAĞITILMASI ESASLARI:**

**8.6.** Kurucunun, yöneticinin ve bunların doğrudan ve dolaylı iştiraklerinin ortağı oldukları menkul kıymet yatırım ortaklıklarının payları hariç olmak koşuluyla; farklı türlerdeki yatırım fonlarının katılma payları , borsa yatırım fonu katılma payları ve yatırım ortaklıklarının payları fon portföyünün %10'una kadar portföye alınabilir. Portföye alınan yatırım fonu katılma payları veya borsa yatırım fonu katılma paylarının toplam tutarı, bu payları çıkaran fonun toplam pay sayısının %20'sini aşamaz. Bir kurucuya ait olan ve/veya aynı yöneticinin yönetimindeki yatırım fonları toplu olarak, hiçbir yatırım fonu veya borsa yatırım fonunun toplam pay sayısının %30'undan fazlasına sahip olamazlar. Ancak, Fon portföyünde yer alan menkul kıymetlerin baz alınan endekse dahil olması halinde söz konusu menkul kıymetlerin endeks içerisinde alabileceği en yüksek ağırlığı geçmemek şartıyla bu sınırlama uygulanmaz.

**8.7.** Fon bankalar nezdinde vadeli mevduat tutamaz, mevduat sertifikası ile yabancı yatırım ortaklıklarının paylarını ve yatırım fonlarının katılma paylarını satın alamaz. Fon portföy değerinin en fazla %20'si nakit değerlendirmek üzere yapılan İMKB Takas ve Saklama Bankası A.Ş. nezdindeki borsa para piyasası işlemlerinden oluşur. Fon'un operasyonel işlemleri nedeniyle oluşabilecek likidite ihtiyacının karşılanması amacıyla nakit tutulabilir. Ayrıca, Vadeli İşlem ve Opsiyon Borsası'nda gerçekleştirilen işlemlerin nakit teminatları da fon portföyüne dahil edilir.

**8.11.** Fon portföy değerinin en az %80'i devamlı olarak mevzuata göre özelleştirme kapsamına alınan kamu iktisadi teşebbüsleri dahil Türkiye'de kurulmuş ortaklıklardan İMKB Ulusal 100 Endeksi'ne dahil olanların hisse senetlerine yatırılır.

**8.13.** Fon portföy değerinin aylık ağırlıklı ortalama bazda en az % 75'i, menkul kıymet yatırım ortaklıkları hisse senetleri hariç olmak üzere İMKB'de işlem gören hisse senetlerinden oluşur. Söz konusu %75 oranının hesaplanmasında, hisse senetlerine ve hisse senedi endekslerine dayalı olarak yapılan vadeli işlem sözleşmelerinin nakit teminatları, hisse senetlerine ve hisse senedi endekslerine dayalı opsiyon sözleşmeleri ve borsada işlem gören hisse senedi ve hisse senedi endeksine dayalı aracı kuruluş varantları da hisse senedi olarak değerlendirilir. Söz konusu orana uyulmasına ilişkin olarak her ay sonunda değerlendirme yapılacaktır.

#### **MADDE 11 – FON'LA İLGİLİ BİLGİLERİN AÇIKLANMA ŞEKLİ:**

**11.1.** Kurucu her hesap döneminin bitiminden itibaren 3 ay içinde Fon'un, bir önceki yıllarla karşılaştırmalı olarak hazırlanmış bağımsız denetimden geçmiş fon bilanço ve gelir tabloları ile fon portföy değeri ve fon toplam değeri tablolarını ve dönem içindeki gelişmeleri takip eden 3 ay içinde, bağımsız denetim raporu ile birlikte Sermaye Piyasası Kurulu'na ve KAP' a gönderirler.

**11.2.** İlgili mevzuatın Ticaret Sicili'ne tescilini öngördüğü diğer hususlar Fon tarafından Türkiye Ticaret Sicili Gazetesi ile KAP' ta duyurulur. Fon ile ilgili bilgilerin açıklanmasında, ayrıca diğer yayın organlarından yararlanılabilir.

**11.3.** Kurucu, her ayı takip eden 15 gün içinde, ay içerisindeki menkul kıymet ve katılma belgesi hareketleri ile fon performansına ilişkin bilgileri içerecek şekilde hazırlanan aylık raporların birer örneğini Sermaye Piyasası Kurulu'na ve KAP 'a gönderilir. Ayrıca, bu raporlarda son bir ay ve üç aylık dönemler itibariyle hesaplanan korelasyon katsayılarına ilişkin bilgilere yer verilir. Söz konusu raporlar aynı zamanda Kurucu merkezinde ve katılma belgesi satışı yapılan yerlerde yatırımcıların incelenmesi için hazır bulundurulur. İlgili aya ilişkin alım satım detaylarına yatırımcıya sunulacak aylık rapor nüshalarında yer verilmez.

FERHAT TEKCEYLAN  
GRUP MÜDÜRÜ

BORA BÖCÜGÖZ  
GENEL MÜDÜR YARDIMCISI