

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Ocak-2023

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-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	870.454.426,92
E-) Katılma Payı Sayısı	:	410.317.632,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.
II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER		
A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	2,121416
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	2,038957
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	4,04
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	4,04
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	42,98
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	80,39
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	0,00
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	7,22
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	25,05
o-)Yatırım Fonu	:	13,18
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	-25,84
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,54
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	94.244.709,19
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	487.465.789,76

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ																			
Hisse Türk																			
AEFES	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9			48.700,00	56,972583	31/01/23			80100517		52,200000	2.542.140,00	0,53	0,22	0,29
AEFES	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9			-32.200,00	56,665841	31/01/23			80100517		52,200000	-1.680.840,00	-0,35	-0,14	-0,19
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			1.756.000,00	32,538674	31/01/23			80100516		16,980000	29.816.880,00	6,22	2,55	3,43
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			1.233.200,00	2,853532	31/01/23			80100516		16,980000	20.939.736,00	4,37	1,79	2,41
ALARK	TL	ALARKO HOLDING A.Ş.			TRAALARK91Q0			25.800,00	72,469412	31/01/23			80100516		69,500000	1.793.100,00	0,37	0,15	0,21
ALARK	TL	ALARKO HOLDING A.Ş.			TRAALARK91Q0			57.600,00	70,355194	31/01/23			80100516		69,500000	4.003.200,00	0,84	0,34	0,46
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			5.000,00	61,983226	31/01/23			80100517		56,800000	284.000,00	0,06	0,02	0,03
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			196.100,00	56,773866	31/01/23			80100517		56,800000	11.138.480,00	2,32	0,95	1,28

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Ocak-2023																			
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.			TREBIMM00018			1.800,00	133,572222	31/01/23					124,500000	224.100,00	0,05	0,02	0,03
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.			TREBIMM00018			1.400,00	124,500000	31/01/23					124,500000	174.300,00	0,04	0,02	0,02
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			TRADOHOL91Q8			33.300,00	8,990496	31/01/23			80100517		8,810000	293.373,00	0,06	0,02	0,03
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			TRADOHOL91Q8			965.500,00	8,805619	31/01/23			80100517		8,810000	8.506.055,00	1,77	0,73	0,98
ECILC	TL	EİS ECZACİBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			304.400,00	30,129239	31/01/23			80100516		25,200000	7.670.880,00	1,60	0,66	0,88
ECILC	TL	EİS ECZACİBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			-213.500,00	28,102223	31/01/23			80100516		25,200000	-5.380.200,00	-1,12	-0,46	-0,62
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			42.700,00	8,079869	31/01/23			80100516		7,850000	335.195,00	0,07	0,03	0,04
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			2.574.000,00	7,838122	31/01/23			80100516		7,850000	20.205.900,00	4,22	1,73	2,32
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			27.300,00	33,623714	31/01/23			80100517		32,980000	900.354,00	0,19	0,08	0,10
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			282.500,00	32,921662	31/01/23			80100517		32,980000	9.316.850,00	1,94	0,80	1,07
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			70.700,00	39,114160	31/01/23					38,100000	2.693.670,00	0,56	0,23	0,31
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			-47.200,00	38,158280	31/01/23					38,100000	-1.798.320,00	-0,38	-0,15	-0,21
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAOTOSN91H6			3.000,00	7.295,330297	31/01/23			80100517		510,100000	1.530.300,00	0,32	0,13	0,18
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAOTOSN91H6			35.100,00	474,389765	31/01/23			80100517		510,100000	17.904.510,00	3,74	1,53	2,06
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			73.400,00	24,016317	31/01/23					24,040000	1.764.536,00	0,37	0,15	0,20
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			123.500,00	24,053723	31/01/23					24,040000	2.968.940,00	0,62	0,25	0,34
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			241.800,00	-59.520,510227	31/01/23			80100516		276,000000	66.736.800,00	13,91	5,72	7,67
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			-105.600,00	100.338,50388	31/01/23			80100516		276,000000	-29.145.600,00	-6,08	-2,50	-3,35
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			5.000,00	11,060716	31/01/23					10,500000	52.500,00	0,01	0,00	0,01
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			801.500,00	10,500000	31/01/23					10,500000	8.415.750,00	1,76	0,72	0,97
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			0,36	41,694444	14/10/22			80100511		31,500000	11,34	0,00	0,00	0,00
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.S.			TRAISCTR91N2			10.300,62	11,651185	31/01/23			80100517		10,880000	112.070,75	0,02	0,01	0,01
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.S.			TRAISCTR91N2			2.228.700,00	10,881430	31/01/23			80100517		10,880000	24.248.256,00	5,06	2,08	2,79
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			44.300,00	11,936562	31/01/23			80100517		11,520000	510.336,00	0,11	0,04	0,06
KARSN	TL	KARSAN OTOMOTİV SANAYİİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			59.100,00	10,969092	31/01/23			80100517		9,200000	543.720,00	0,11	0,05	0,06
KARSN	TL	KARSAN OTOMOTİV SANAYİİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			225.000,00	8,811720	31/01/23			80100517		9,200000	2.070.000,00	0,43	0,18	0,24
KCHOL	TL	A.Ş. KOÇ HOLDİNG			TRAKCHOL91Q8			8.100,00	79,709374	31/01/23					76,450000	619.245,00	0,13	0,05	0,07
KCHOL	TL	A.Ş. KOÇ HOLDİNG			TRAKCHOL91Q8			173.500,00	76,315980	31/01/23					76,450000	13.264.075,00	2,77	1,14	1,52
KOZAA	TL	A.Ş. KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			16.800,00	57,011055	31/01/23					53,050000	891.240,00	0,19	0,08	0,10
KOZAA	TL	A.Ş. KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			30.000,00	50,311422	31/01/23					53,050000	1.591.500,00	0,33	0,14	0,18
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK			TRAKRDMR91G7			29.700,00	17,960794	31/01/23			80100517		16,470000	489.159,00	0,10	0,04	0,06

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Ocak-2023																			
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
KRDM	TL	SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D) KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D) MİGROS TİCARET A.Ş.			TRAKRDMR91G7			250.600,00	16,315013	31/01/23			80100517		16,470000	4.127.382,00	0,86	0,35	0,47
MGROS	TL	ODAS ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREMGTI00012			2.900,00	158,182934	31/01/23			80100517		137,800000	399.620,00	0,08	0,03	0,05
MGROS	TL	ODAS ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREMGTI00012			8.100,00	135,361962	31/01/23			80100517		137,800000	1.116.180,00	0,23	0,10	0,13
ODAS	TL	ODAS ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			0,99	8,727273	27/01/23					7,750000	7,67	0,00	0,00	0,00
ODAS	TL	ODAS ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			1.003.200,00	7,750000	31/01/23					7,750000	7.774.800,00	1,62	0,67	0,89
OYAKC	TL	OYAK ÇİMENTO A.Ş.			TRAMRDIN91F2			84.400,00	30,051393	27/01/23			80100517		21,420000	1.807.848,00	0,38	0,16	0,21
OYAKC	TL	OYAK ÇİMENTO A.Ş.			TRAMRDIN91F2			236.700,00	21,424714	31/01/23			80100517		21,420000	5.070.114,00	1,06	0,43	0,58
PETKM	TL	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.			TRAPETKM91E0			4.000,00	16,762120	31/01/23			80100517		16,330000	65.320,00	0,01	0,01	0,01
PETKM	TL	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.			TRAPETKM91E0			292.100,00	16,332114	31/01/23			80100517		16,330000	4.769.993,00	1,00	0,41	0,55
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			3.500,00	19.759,691720	31/01/23					494,100000	1.729.350,00	0,36	0,15	0,20
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			23.900,00	494,100000	31/01/23					494,100000	11.808.990,00	2,46	1,01	1,36
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			22.000,00	39,998771	31/01/23			80100517		39,020000	858.440,00	0,18	0,07	0,10
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			950.300,00	39,059328	31/01/23			80100517		39,020000	37.080.706,00	7,74	3,18	4,26
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			0,98	78,306122	02/12/22					100,300000	98,29	0,00	0,00	0,00
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			323.500,00	41,779566	31/01/23			80100517		39,540000	12.791.190,00	2,67	1,10	1,47
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			571.500,00	39,192659	31/01/23			80100517		39,540000	22.597.110,00	4,71	1,94	2,60
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			287.500,00	36,505562	31/01/23			80100517		26,400000	7.590.000,00	1,58	0,65	0,87
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			31.000,00	32,447630	31/01/23			80100517		26,400000	818.400,00	0,17	0,07	0,09
TAVHL	TL	TAV HAVALIMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			4.000,00	86,022220	31/01/23					82,650000	330.600,00	0,07	0,03	0,04
TAVHL	TL	TAV HAVALIMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			20.600,00	82,566139	31/01/23					82,650000	1.702.590,00	0,36	0,15	0,20
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			7.900,00	39,357544	31/01/23			80100517		36,300000	286.770,00	0,06	0,02	0,03
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			55.000,00	36,184135	31/01/23			80100517		36,300000	1.996.500,00	0,42	0,17	0,23
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			5.600,00	151,756257	31/01/23			80100517		137,600000	770.560,00	0,16	0,07	0,09
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			176.000,00	139,327596	31/01/23			80100517		137,600000	24.217.600,00	5,05	2,08	2,78
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			TRETKHO00012			2.000,00	47,243405	31/01/23			80100517		38,940000	77.880,00	0,02	0,01	0,01
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			TRETKHO00012			182.100,00	39,501776	31/01/23			80100517		38,940000	7.090.974,00	1,48	0,61	0,81
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			22.700,00	169,328925	31/01/23			80100517		158,100000	3.588.870,00	0,75	0,31	0,41
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			44.000,00	157,956019	31/01/23			80100517		158,100000	6.956.400,00	1,45	0,60	0,80
TRGYO	TL	TORUNLAR GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRETRGY00018			277.100,00	16,577035	31/01/23			80100517		15,930000	4.414.203,00	0,92	0,38	0,51
TRGYO	TL	TORUNLAR GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRETRGY00018			30.500,00	15,709692	31/01/23			80100517		15,930000	485.865,00	0,10	0,04	0,06
TTKOM	TL	TÜRK			TRETTLK00013			119.000,00	22,229715	31/01/23			80100517		20,540000	2.444.260,00	0,51	0,21	0,28

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Ocak-2023																			
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
VIOP Nakit Teminatı								77.005.341,55								77.005.341,55	100,00	6,60	
GRUP TOPLAMI								77.005.341,55								77.005.341,55	100,00	6,60	
GRUP TOPLAMI								77.005.341,55								77.005.341,55	100,00	6,60	
FON PORTFÖY DEĞERİ															1.167.269.609,06		100,00		

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	1.167.269.609,06	134,10 %
B-)HAZIR DEĞERLER	9.156,80	0,00 %
C-)ALACAKLAR	197.949.219,17	22,74 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-494.773.558,21	-56,84 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	870.454.426,92	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	2.301.012,08	0,2643 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	380,40	0,0000 %
Kayda Alma Ücreti	14.560,16	0,0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	56.208,63	0,0065 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1.167.201,37	0,1341 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	200,71	0,0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.015,80	0,0001 %
	3.540.579,15	0,4067 %

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

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

B-Geçen Ay İçinde Yatırım Fonlarına İlişkin Mevzuatta Meydana Gelen Değişme ve Hukuki İhtilaflarla İlgili Açıklamalar