

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Mayıs-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)
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			183.400,00	42,357973	31/05/23			80100511		47,500000	8.711.500,00	2,21	1,79	2,04
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			163.500,00	52,370134	31/05/23			80100511		47,500000	7.766.250,00	1,97	1,59	1,82
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.			TREBIMM00018			12.500,00	135,208000	26/05/23					141,000000	1.762.500,00	0,45	0,36	0,41
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.			TREBIMM00018			26.400,00	140,893561	31/05/23					141,000000	3.722.400,00	0,94	0,76	0,87
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			1.090.000,00	8,292818	31/05/23			80100511		8,330000	9.079.700,00	2,30	1,86	2,12
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			-18.500,00	8,325685	31/05/23			80100511		8,330000	-154.105,00	-0,04	-0,03	-0,04
ECILC	TL	EİS ECZACIBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			61.900,00	26,381909	31/05/23			80100511		27,680000	1.713.392,00	0,43	0,35	0,40
ECILC	TL	EİS ECZACIBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			135.400,00	27,991807	31/05/23			80100511		27,680000	3.747.872,00	0,95	0,77	0,88
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			5.000,00	6,335044	31/05/23			80100511		7,110000	35.550,00	0,01	0,01	0,01
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			972.600,00	7,373392	31/05/23			80100511		7,110000	6.915.186,00	1,75	1,42	1,62
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			39.500,00	27,435277	31/05/23			80100511		31,000000	1.224.500,00	0,31	0,25	0,29
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			296.900,00	31,010441	31/05/23			80100511		31,000000	9.203.900,00	2,33	1,89	2,15
ENKAI	TL	ENKA İNSAAT VE SANAYİ A.Ş.			TREENKA00011			392.000,00	24,019074	31/05/23			80100511		25,860000	10.137.120,00	2,57	2,08	2,37
ENKAI	TL	ENKA İNSAAT VE SANAYİ A.Ş.			TREENKA00011			-122.400,00	24,548391	31/05/23			80100511		25,860000	-3.165.264,00	-0,80	-0,65	-0,74
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			11.000,00	30,929589	31/05/23			80100511		33,040000	363.440,00	0,09	0,08	0,09
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			446.700,00	33,124811	31/05/23			80100511		33,040000	14.758.968,00	3,74	3,03	3,45
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAOTOSN91H6			18.400,00	533,941767	31/05/23			80100511		573,200000	10.546.880,00	2,67	2,16	2,47
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAOTOSN91H6			-9.100,00	538,119831	31/05/23			80100511		573,200000	-5.216.120,00	-1,32	-1,07	-1,22
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			113.300,00	24,240631	31/05/23			80100511		26,780000	3.034.174,00	0,77	0,62	0,71
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			452.300,00	27,201366	31/05/23			80100511		26,780000	12.112.594,00	3,07	2,49	2,83
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			403.600,00	222,441732	31/05/23			80100511		259,000000	104.532.400,00	26,51	21,47	24,46
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			-150.900,00	223,765446	31/05/23			80100511		259,000000	-39.083.100,00	-9,90	-8,02	-9,14
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			100.500,36	25,308751	31/05/23			80100511		27,860000	2.799.940,03	0,71	0,58	0,66
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			-60.400,00	26,207870	31/05/23			80100511		27,860000	-1.682.744,00	-0,43	-0,35	-0,39
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			774.900,62	10,608803	31/05/23			80100511		11,150000	8.640.141,91	2,19	1,77	2,02
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			393.600,00	12,155992	31/05/23			80100511		11,150000	4.388.640,00	1,11	0,90	1,03
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			436.500,00	8,430856	31/05/23			80100511		8,900000	3.884.850,00	0,98	0,80	0,91
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			-82.900,00	8,526179	31/05/23			80100511		8,900000	-737.810,00	-0,19	-0,15	-0,17
KARSN	TL	KARSAN OTOMOTİV SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			404.500,00	8,354849	31/05/23			80100511		8,620000	3.486.790,00	0,88	0,72	0,82
KARSN	TL	KARSAN OTOMOTİV			TRAKARSN91H7			-2.800,00	8,403799	31/05/23			80100511		8,620000	-24.136,00	-0,01	-0,01	-0,01

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Mayıs-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)
KCHOL	TL	SANAYİİ VE TİCARET A.Ş. KOÇ HOLDİNG			TRAKCHOL91Q8			3.500,00	76,863820	31/05/23					78,800000	275.800,00	0,07	0,06	0,06
KCHOL	TL	A.Ş. KOÇ HOLDİNG			TRAKCHOL91Q8			118.200,00	80,964831	31/05/23					78,800000	9.314.160,00	2,36	1,91	2,18
KOZAA	TL	A.Ş. KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİ K			TREKOZA00014			110.200,00	40,302502	31/05/23			80100511		45,100000	4.970.020,00	1,26	1,02	1,16
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİ K			TREKOZA00014			141.400,00	47,874258	31/05/23			80100511		45,100000	6.377.140,00	1,62	1,31	1,49
KOZAL	TL	KOZA ALTIN			TREKOAL00014			900.700,00	18,674314	31/05/23			80100511		23,020000	20.734.114,00	5,25	4,26	4,85
KOZAL	TL	İŞLETMELE Rİ A.Ş. KOZA ALTIN			TREKOAL00014			-750.000,00	19,695445	31/05/23			80100511		23,020000	-17.265.000,00	-4,37	-3,54	-4,04
KRDMD	TL	İŞLETMELE Rİ A.Ş. KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK			TRAKRDMR91G7			236.000,00	16,425698	31/05/23			80100511		17,570000	4.146.520,00	1,05	0,85	0,97
KRDMD	TL	SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D) KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK			TRAKRDMR91G7			690.400,00	17,852661	31/05/23			80100511		17,570000	12.130.328,00	3,07	2,49	2,84
MGROS	TL	SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D) MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			160.400,00	178,577433	31/05/23			80100511		172,500000	27.669.000,00	7,01	5,68	6,47
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			-151.400,00	178,565650	31/05/23			80100511		172,500000	-26.116.500,00	-6,62	-5,36	-6,11
ODAS	TL	A.Ş. ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			842.200,99	5,615364	31/05/23			80100511		6,620000	5.575.370,55	1,41	1,14	1,30
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			-8.300,00	-8,805510	31/05/23			80100511		6,620000	-54.946,00	-0,01	-0,01	-0,01
PETKM	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş. PETKİM PETROKİM YA			TRAPETKM91E0			2.603.100,00	13,164038	31/05/23			80100511		13,990000	36.417.369,00	9,23	7,48	8,52
PETKM	TL	HOLDİNG A.Ş. PETKİM PETROKİM YA			TRAPETKM91E0			-2.498.600,00	13,167415	31/05/23			80100511		13,990000	-34.955.414,00	-8,86	-7,18	-8,18
PGSUS	TL	HOLDİNG A.Ş. PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			2.200,00	425,450127	30/05/23			80100511		458,800000	1.009.360,00	0,26	0,21	0,24
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			31.800,00	459,398904	31/05/23			80100511		458,800000	14.589.840,00	3,70	3,00	3,41
SAHOL	TL	A.Ş. HACİ ÖMER SABANCI HOLDİNG			TRASAHOL91Q5			1.500,00	38,527127	31/05/23			80100511		38,600000	57.900,00	0,01	0,01	0,01
SAHOL	TL	A.Ş. HACİ ÖMER SABANCI HOLDİNG			TRASAHOL91Q5			266.800,00	38,656035	31/05/23			80100511		38,600000	10.298.480,00	2,61	2,11	2,41
SASA	TL	A.Ş. SASA POLYESTER SANAYİ			TRASASAW91E4			9.202,25	50,749011	30/05/23			80100511		54,000000	496.921,50	0,13	0,10	0,12
SASA	TL	A.Ş. SASA POLYESTER SANAYİ			TRASASAW91E4			-9.200,00	53,631111	31/05/23			80100511		54,000000	-496.800,00	-0,13	-0,10	-0,12
SISE	TL	A.Ş. TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM			TRASISEW91Q3			21.300,00	36,564939	31/05/23			80100511		40,360000	859.668,00	0,22	0,18	0,20
SISE	TL	FABRİKALA Rİ A.Ş. TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM			TRASISEW91Q3			506.200,00	40,532894	31/05/23			80100511		40,360000	20.430.232,00	5,18	4,19	4,78
SOKM	TL	FABRİKALA Rİ A.Ş. ŞOK MARKETLER TİCARET			TRESOKM00022			2.000,00	27,944125	31/05/23			80100511		27,200000	54.400,00	0,01	0,01	0,01
SOKM	TL	A.Ş. ŞOK MARKETLER TİCARET			TRESOKM00022			109.600,00	27,224248	31/05/23			80100511		27,200000	2.981.120,00	0,76	0,61	0,70
TAVHL	TL	A.Ş. TAV HAVALIMANLARI HOLDİNG			TRETAVH00018			1.000,00	68,029370	31/05/23			80100511		77,650000	77.650,00	0,02	0,02	0,02
TAVHL	TL	A.Ş. TAV HAVALIMANLARI HOLDİNG			TRETAVH00018			227.000,00	77,688207	31/05/23			80100511		77,650000	17.626.550,00	4,47	3,62	4,12
TCELL	TL	A.Ş. TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			9.000,00	33,552152	31/05/23					33,500000	301.500,00	0,08	0,06	0,07
TCELL	TL	A.Ş. TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			36.900,00	35,089355	31/05/23					33,500000	1.236.150,00	0,31	0,25	0,29
THYAO	TL	A.Ş. TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			72.900,00	133,248923	31/05/23			80100511		143,800000	10.483.020,00	2,66	2,15	2,45
THYAO	TL	A.Ş. TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			55.000,00	159,866933	31/05/23			80100511		143,800000	7.909.000,00	2,00	1,62	1,85

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

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	487.140.970,79	113,97 %
B-)HAZIR DEĞERLER	22.002,44	0,01 %
C-)ALACAKLAR	423.810.531,98	99,15 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-493.552.486,47	-115,47 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	427.424.763,28	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	445.848,01	0,1043 %
Fon Yönetim Ücreti	1.127.915,29	0,2639 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	380,40	0,0001 %
Kayda Alma Ücreti	7.110,62	0,0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	31.554,05	0,0074 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	1.274,59	0,0003 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.015,80	0,0002 %
BİST KYD Ücreti	9.294,07	0,0022 %
	1.624.392,83	0,3801 %

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
SASA	Bedelsiz Sermaye Artırımı	25/05/23	1,27	52,90
DOHOL	Temmettü	10/05/23	10.890,59	10.890,59
AKSEN	Temmettü	05/05/23	407,72	407,72

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