

DPI-DENİZ PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİSSE SENEDİ SERBEST FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

Temmuz-2026

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı

:

DPI-DENİZ PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİSSE SENEDİ

B-)Kurucunun Ünvanı

:

SERBEST FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

C-)Yöneticinin Ünvanı

:

DENİZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.

D-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri

:

370.554.204,75

E-) Katılma Payı Sayısı

:

42.605.191,000

F-)Fonun Kuruluş Tarihi

:

02 Mart 2020

G-)Fonun Süresi

:

Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)

:

8,697396

B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)

:

8,452037

C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)

:

2,90

D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı

:

21,63

E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı

:

40,65

F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi

a-)Hisse Senedi

:

86,98

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

g2-)BPP-BPP Borçlanma

:

0,00

h-)Opsiyon

:

0,00

i-) Varant

:

0,00

j-)Değerli Maden

:

0,00

k-)Mevduat

:

0,21

l-) Katılım Hesabı

:

0,00

m-)Diğer

:

0,00

n-)Teminat

:

15,18

o-)Yatırım Fonu

:

0,24

p-)Borsa Yatırım Fonu

:

0,00

r-)Repo-Trepo

:

-2,61

s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri

:

0,00

t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri

:

0,00

G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı

a-)Hisse Senedi

:

3,56

b-)Hazine Bonosu

:

0,00

c-)Devlet Tahvili

:

0,00

d-)Opsiyon

:

0,00

e-)Varant

:

0,00

f-)Diğer

:

4,14

H-)Portföyün Ortalama Vadesi

:

0,00

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)

:

12.126.688,42

:

7.438.570,96

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																			
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			335.600,00	76,941962	10/07/26			80100511		63,400000	21.277.040,00	6,82	6,58	5,74
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			60.000,00	67,646057	31/07/26			80100511		63,400000	3.804.000,00	1,22	1,18	1,03
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			45.500,00	360,084756	23/07/26			80100511		342,250000	15.572.375,00	4,99	4,81	4,20
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			39.900,00	345,502809	31/07/26			80100511		342,250000	13.655.775,00	4,38	4,22	3,69
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			904.400,00	20,320695	27/07/26			80100517		17,910000	16.197.804,00	5,19	5,01	4,37
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			-381.200,00	17,703917	31/07/26			80100517		17,910000	-6.827.292,00	-2,19	-2,11	-1,84

DPI-DENİZ PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİSSE SENEDİ SERBEST FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

Temmuz-2026

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)			
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			57.300,00	40,932404	27/07/26			80100517		42,540000	2.437.542,00	0,78	0,75	0,66			
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			397.000,00	42,151187	31/07/26			80100517		42,540000	16.888.380,00	5,42	5,22	4,56			
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAOTOSN91H6			114.100,00	84,169042	29/07/26			80100517		80,100000	9.139.410,00	2,93	2,82	2,47			
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAOTOSN91H6			-14.100,00	81,448545	31/07/26			80100517		80,100000	-1.129.410,00	-0,36	-0,35	-0,30			
GARAN	TL	GARANTI BANKASI			TRAGARAN91N1			223.900,00	137,482304	02/07/26			80100517		123,400000	27.629.260,00	8,86	8,54	7,46			
GARAN	TL	GARANTI BANKASI			TRAGARAN91N1			29.100,00	128,333199	31/07/26			80100517		123,400000	3.590.940,00	1,15	1,11	0,97			
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			1.034.200,00	36,202891	31/07/26			80100517		37,440000	38.720.448,00	12,42	11,97	10,45			
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			-508.700,00	36,313299	31/07/26			80100517		37,440000	-19.045.728,00	-6,11	-5,89	-5,14			
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.S.			TRAISCTR91N2			10.000,65	14,605506	31/07/26			80100517		12,470000	124.708,16	0,04	0,04	0,03			
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.S.			TRAISCTR91N2			2.192.200,00	12,123512	31/07/26			80100517		12,470000	27.336.734,00	8,77	8,45	7,38			
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMR91G7			52.300,00	40,773423	31/07/26			80100511		41,200000	2.154.760,00	0,69	0,67	0,58			
OYAKC	TL	OYAK ÇİMENTO A.Ş.			TRAMRDIN91F2			523.300,00	20,318607	31/07/26			80100511		20,300000	10.622.990,00	3,41	3,28	2,87			
PETKM	TL	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.			TRAPETKM91E0			424.800,00	19,697912	02/07/26			80100511		19,120000	8.122.176,00	2,60	2,51	2,19			
PETKM	TL	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.			TRAPETKM91E0			60.200,00	18,977034	31/07/26					19,120000	1.151.024,00	0,37	0,36	0,31			
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			25.000,00	177,384694	14/07/26			80100511		153,000000	3.825.000,00	1,23	1,18	1,03			
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			-12.400,00	167,406632	31/07/26			80100511		153,000000	-1.897.200,00	-0,61	-0,59	-0,51			
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			69.900,00	89,896096	22/07/26			80100511		84,500000	5.906.550,00	1,89	1,82	1,59			
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			73.400,00	85,265053	31/07/26			80100511		84,500000	6.202.300,00	1,99	1,92	1,67			
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			4.605.650,00	2,468371	31/07/26			80100511		2,470000	11.375.982,77	3,65	3,51	3,07			
Tem.Ver. SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			19.877.050,00	2,468371	31/07/26			80100511		2,470000	49.096.286,23	15,76	15,17				
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			-12.541.800,00	2,466423	31/07/26			80100511		2,470000	-30.978.246,00	-9,93	-9,57	-8,36			
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			440.000,00	44,440510	09/07/26			80100511		41,740000	18.365.600,00	5,89	5,68	4,96			
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			-295.400,00	43,683021	31/07/26			80100511		41,740000	-12.329.996,00	-3,95	-3,81	-3,33			
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			64.200,00	323,964940	31/07/26			80100511		314,000000	20.158.800,00	6,46	6,23	5,44			
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			-38.100,00	320,432992	31/07/26			80100511		314,000000	-11.963.400,00	-3,84	-3,70	-3,23			
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			TRETKHO00012			61.300,00	151,935080	31/07/26			80100511		154,500000	9.470.850,00	3,04	2,93	2,56			
TRALT	TL	TÜRK ALTIN İŞLETMENLERİ A.Ş.			TREKOAL00014			132.300,00	46,402468	22/07/26			80100511		44,160000	5.842.368,00	1,87	1,80	1,58			
TRALT	TL	TÜRK ALTIN İŞLETMENLERİ A.Ş.			TREKOAL00014			210.200,00	44,655195	31/07/26			80100511		44,160000	9.282.432,00	2,98	2,87	2,51			
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			TRETTLK00013			570.000,00	51,905336	31/07/26			80100511		51,000000	29.070.000,00	9,32	8,98	7,85			
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			TRETTLK00013			-328.100,00	51,351005	31/07/26			80100511		51,000000	-16.733.100,00	-5,37	-5,17	-4,52			
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			TRAYKBNK91N6			624.300,00	35,257351	29/07/26			80100511		32,760000	20.452.068,00	6,56	6,32	5,52			
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			TRAYKBNK91N6			160.300,00	32,802667	31/07/26			80100511		32,760000	5.251.428,00	1,68	1,62	1,42			
GRUP TOPLAMI								19.297.600,65											311.820.659,16	100,00	96,36	70,93
GRUP TOPLAMI								19.297.600,65											311.820.659,16	100,00	96,36	70,93
MEVDUAT																						
DENİZBANK A.Ş.	TL		03/08/26	0		35,00		975.033,43		31/07/26				977.838,32	35,000000	977.838,32	100,00	0,30	0,26			

DPI-DENİZ PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİSSE SENEDİ SERBEST FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)																				
Temmuz-2026																				
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)	
GRUP TOPLAMI								975.033,43								977.838,32	100,00	0,30	0,26	
GRUP TOPLAMI								975.033,43								977.838,32	100,00	0,30	0,26	
TÜREV																				
Futures																				
Kısa																				
F_AKBNK0826	TL				F_AKBNK0826			3.956,00	63,766100	31/07/26			80105125		65,070000	25.741.692,00	0,00	0,00	0,00	
F_ASELS0826	TL				F_ASELS0826			854,00	351,985700	31/07/26			80105125		351,500000	30.018.100,00	0,00	0,00	0,00	
F_EKGYO0826	TL				F_EKGYO0826			5.232,00	18,112100	31/07/26			80105125		18,370000	9.611.184,00	0,00	0,00	0,00	
F_EREGL0826	TL				F_EREGL0826			4.543,00	43,298800	31/07/26			80105125		43,680000	19.843.824,00	0,00	0,00	0,00	
F_FROTO0826	TL				F_FROTO0826			1.000,00	80,589600	31/07/26			80105125		82,210000	8.221.000,00	0,00	0,00	0,00	
F_GARAN0826	TL				F_GARAN0826			2.530,00	124,436600	31/07/26			80105125		126,850000	32.093.050,00	0,00	0,00	0,00	
F_HALKB0826	TL				F_HALKB0826			5.255,00	37,442300	31/07/26			80105125		38,320000	20.137.160,00	0,00	0,00	0,00	
F_ISCTR0826	TL				F_ISCTR0826			22.022,00	12,421200	31/07/26			80105125		12,800000	28.188.160,00	0,00	0,00	0,00	
F_KRDMD0826	TL				F_KRDMD0826			523,00	41,832800	31/07/26			80105125		42,430000	2.219.089,00	0,00	0,00	0,00	
F_OYAKC0826	TL				F_OYAKC0826			5.233,00	20,853600	31/07/26			80105125		20,860000	10.916.038,00	0,00	0,00	0,00	
F_PETKM0826	TL				F_PETKM0826			4.850,00	19,426600	31/07/26			80105125		19,650000	9.530.250,00	0,00	0,00	0,00	
F_PGSUS0826	TL				F_PGSUS0826			126,00	155,030200	31/07/26			80105125		157,100000	1.979.460,00	0,00	0,00	0,00	
F_SAHOL0826	TL				F_SAHOL0826			1.433,00	85,280100	31/07/26			80105125		86,960000	12.461.368,00	0,00	0,00	0,00	
F_SASA0826	TL				F_SASA0826			119.409,00	2,528800	31/07/26			80105125		2,550000	30.449.295,00	0,00	0,00	0,00	
F_SISE0826	TL				F_SISE0826			1.446,00	42,540500	31/07/26			80105125		42,840000	6.194.664,00	0,00	0,00	0,00	
F_THYAO0826	TL				F_THYAO0826			261,00	319,990800	31/07/26			80105125		322,250000	8.410.725,00	0,00	0,00	0,00	
F_TKFEN0826	TL				F_TKFEN0826			613,00	155,851800	31/07/26			80105125		159,450000	9.774.285,00	0,00	0,00	0,00	
F_TRALT0826	TL				F_TRALT0826			3.425,00	45,214100	31/07/26			80105125		45,400000	15.549.500,00	0,00	0,00	0,00	
F_TTKOM0826	TL				F_TTKOM0826			2.419,00	51,709800	31/07/26			80105125		52,300000	12.651.370,00	0,00	0,00	0,00	
F_YKBNK0826	TL				F_YKBNK0826			7.846,00	32,608400	31/07/26			80105125		33,610000	26.370.406,00	0,00	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								192.976,00								320.360.620,00	0,00	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								192.976,00								320.360.620,00	0,00	0,00	0,00	
REPO																				
SASA			03/08/26	0		45,00		48.679.383,56	45,000000	31/07/26		19.877.050,00	81796766	48.679.383,56	45,000000	-48.679.383,56	100,00	-15,04	-13,14	
GRUP TOPLAMI								48.679.383,56								-48.679.383,56	100,00	-15,04	-13,14	
GRUP TOPLAMI								48.679.383,56								-48.679.383,56	100,00	-15,04	-13,14	
VIOP Nakit Teminatı																				
VIOP Nakit Teminatı								59.479.600,34								59.479.600,34	100,00	18,38		
GRUP TOPLAMI								59.479.600,34								59.479.600,34	100,00	18,38		
GRUP TOPLAMI								59.479.600,34								59.479.600,34	100,00	18,38		
FON PORTFÖY DEĞERİ																323.598.714,26	100,00			

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	323.598.714,26	87,33 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0,00	0,00 %
C-)ALACAKLAR	450.289.206,57	121,52 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-403.333.716,18	-108,85 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	370.554.204,75	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	1.067.228,36	0,2880 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	3.026,76	0,0008 %
Kayda Alma Ücreti	6.644,83	0,0018 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	24.809,02	0,0067 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	175.295,48	0,0473 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	1.876,20	0,0005 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	18.461,19	0,0050 %
Diğer Harcamalar	2.261,00	0,0006 %
BİST KYD Ücreti	3.983,43	0,0011 %
	1.303.586,27	0,3518 %

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
MEYSU	Temmettü	09/07/26	0,05	0,05
TAVHL	Temmettü	23/07/26	98.732,94	98.732,94

DPI-DENİZ PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİSSE SENEDİ SERBEST FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)
Temmuz-2026

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