

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Mart-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-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	244.687.595,82
E-) Katılma Payı Sayısı	:	203.296.693,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,203599
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,179337
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,06
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	5,25
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	19,14
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	72,93
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	:	0,40
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,59
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	18,94
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	7,14
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00

G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,32
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)	:	26.699.544,58
---	---	---------------

İ-Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit : 2.719.086,46
Çıkışları (TL)

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 SÖZLEŞM E NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)			
T.REPO																						
TRT290125T15	TL	HAZİNE	01/04/21	0	TRT290125T15	18,95	2	50.025.958,90	18,950000	31/03/21		43.682.795,00	74086111	50.025.958,90	18,950000	50.025.958,90	43,86	29,73	20,44			
TRT290125T15	TL	HAZİNE	01/04/21	0	TRT290125T15	18,95	2	50.025.958,90	18,950000	31/03/21		43.682.795,00	74086111	50.025.958,90	18,950000	50.025.958,90	43,86	29,74	20,44			
TRT290125T15	TL	HAZİNE	01/04/21	0	TRT290125T15	18,95	2	14.007.268,49	18,950000	31/03/21		12.231.185,00	74086111	14.007.268,49	18,950000	14.007.268,49	12,28	8,33	5,72			
GRUP TOPLAMI								114.059.186,29										114.059.186,29		100,00	67,80	46,60
GRUP TOPLAMI								114.059.186,29										114.059.186,29		100,00	67,80	46,60
TPP																						
TPP			01/04/21	0		18,90		781.404,41	18,900000	31/03/21			63937	781.404,41	18,900000	781.404,41	100,00	0,47	0,32			
GRUP TOPLAMI								781.404,41										781.404,41		100,00	0,47	0,32
GRUP TOPLAMI								781.404,41										781.404,41		100,00	0,47	0,32
VIOP Nakit Teminatı																						
VIOP Nakit Teminatı								53.364.025,74										53.364.025,74		100,00	31,73	
GRUP TOPLAMI								53.364.025,74										53.364.025,74		100,00	31,73	
GRUP TOPLAMI								53.364.025,74										53.364.025,74		100,00	31,73	
FON PORTFÖY DEĞERİ																168.204.616,44		100,00				

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
----------	-------	-------

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Mart-2021

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	168.204.616,44	68,74 %
B-)HAZIR DEĞERLER	40.324,05	0,02 %
C-)ALACAKLAR	88.223.739,41	36,06 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-11.781.084,08	-4,81 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	244.687.595,82	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	565.053,40	0,2309 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	585,79	0,0002 %
Kayda Alma Ücreti	5.591,14	0,0023 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	16.584,86	0,0068 %
Alınan Kredi Faizleri	15,29	0,0000 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	174.150,44	0,0712 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	69,50	0,0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.060,82	0,0004 %
Diğer Harcamalar	338,38	0,0001 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	204,05	0,0001 %
	763.653,67	0,3120 %

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
TOASO	Temmettü	25/03/21	97.800,00	97.800,00
FROTO	Temmettü	26/03/21	1.284.000,00	1.284.000,00
EREGL	Temmettü	26/03/21	23.865,00	23.865,00
AKBNK	Temmettü	30/03/21	23.417,80	23.417,80
ARCLK	Temmettü	31/03/21	1.180.948,18	1.180.948,18

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