

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Nisan-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	:	274.170.567,02
E-) Katılma Payı Sayısı	:	224.060.209,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,223647
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,203599
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	1,67
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	7,01
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	19,48
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	71,97
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	:	0,35
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,17
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	19,52
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	7,99
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00

G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,34
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)	:	34.642.373,98
--	---	---------------

i-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	9.651.426,88
---	---	--------------

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																			
ALKİM	TL	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			TRAALKİM91E0			15.800,00	16,956656	30/04/21					17,220000	272.076,00	1,15	0,23	0,10
ALKİM	TL	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			TRAALKİM91E0			34.200,00	17,115766	30/04/21					17,220000	588.924,00	2,48	0,50	0,21
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			262.900,00	15,130320	30/04/21					15,000000	3.943.500,00	16,64	3,32	1,44
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			-87.900,00	15,128195	30/04/21					15,000000	-1.318.500,00	-5,56	-1,11	-0,48
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			1.854.300,00	3,000898	30/04/21					2,950000	5.470.185,00	23,08	4,60	2,00
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			-1.454.300,00	3,000898	30/04/21					2,950000	-4.290.185,00	-18,10	-3,61	-1,56
ECİLC	TL	EİS ECZACİBAŞI İLAÇ, SİNAL VE FİNANSAL YATIRIMLA			TRAECİLC91E0			108.800,00	6,304881	30/04/21					6,400000	696.320,00	2,94	0,59	0,25

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Nisan-2021																			
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)
ECILC	TL	R SANAYİ VE TİCARET A.Ş. EİS ECZACIBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			110.800,00	6,326009	30/04/21					6,400000	709.120,00	2,99	0,60	0,26
ENKAI	TL	ENKA İNSAAT VE SANAYİ A.Ş.			TREENKA00011			60.000,00	7,600621	30/04/21					7,850000	471.000,00	1,99	0,40	0,17
ENKAI	TL	ENKA İNSAAT VE SANAYİ A.Ş.			TREENKA00011			-49.500,00	7,609111	30/04/21					7,850000	-388.575,00	-1,64	-0,33	-0,14
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			150.163,70	10,033677	30/04/21					8,200000	1.231.342,34	5,19	1,04	0,45
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			-37.640,00	8,309826	30/04/21					8,200000	-308.648,00	-1,30	-0,26	-0,11
IPEKE	TL	İPEK DOĞAL ENERJİ KAYNAKLARI ARAŞTIRMA VE ÜRETİM A.Ş.			TRAIPMAT92D2			36.300,00	12,266155	30/04/21					12,530000	454.839,00	1,92	0,38	0,17
IPEKE	TL	İPEK DOĞAL ENERJİ KAYNAKLARI ARAŞTIRMA VE ÜRETİM A.Ş.			TRAIPMAT92D2			51.700,00	12,849466	30/04/21					12,530000	647.801,00	2,73	0,54	0,24
ISFIN	TL	İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.			TRAISGEN91P9			69.100,00	2,977164	30/04/21					3,330000	230.103,00	0,97	0,19	0,08
ISFIN	TL	İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.			TRAISGEN91P9			123.700,00	3,170842	30/04/21					3,330000	411.921,00	1,74	0,35	0,15
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			67.000,00	1,821866	29/04/21					1,860000	124.620,00	0,53	0,11	0,05
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			133.000,00	1,868353	30/04/21					1,860000	247.380,00	1,04	0,21	0,09
KARSN	TL	KARŞAN OTOMOTİV SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			97.800,00	3,415736	30/04/21					3,360000	328.608,00	1,39	0,28	0,12
KARSN	TL	KARŞAN OTOMOTİV SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			44.500,00	3,419191	29/04/21					3,360000	149.520,00	0,63	0,13	0,05
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			90.100,00	18,445472	30/04/21					18,310000	1.649.731,00	6,96	1,39	0,60
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			2.600,00	16,391058	30/04/21					18,310000	47.606,00	0,20	0,04	0,02
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			1.494.500,00	14,558822	30/04/21					13,770000	20.579.265,00	86,82	17,31	7,51
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			-1.438.500,00	14,509723	30/04/21					13,770000	-19.808.145,00	-83,56	-16,66	-7,22
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			158.300,00	37,499849	30/04/21					36,300000	5.746.290,00	24,24	4,83	2,10
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			-138.200,00	37,436180	30/04/21					36,300000	-5.016.660,00	-21,16	-4,22	-1,83
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			116.400,00	2,423127	30/04/21					2,470000	287.508,00	1,21	0,24	0,10
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			296.400,00	2,390730	30/04/21					2,470000	732.108,00	3,09	0,62	0,27
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			20.250,49	33,817004	30/04/21					35,800000	724.967,54	3,06	0,61	0,26
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			-20.250,00	33,816327	30/04/21					35,800000	-724.950,00	-3,06	-0,61	-0,26
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			4.650.100,00	7,367037	30/04/21					7,510000	34.922.251,00	147,30	29,37	12,74
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			-4.250.100,00	7,367037	30/04/21					7,510000	-31.918.251,00	-134,65	-26,84	-11,64
SKBNK	TL	ŞEKERBANK T.A.Ş.			TRASKBNK91N8			2.400,00	1,060000	29/04/21					1,090000	2.616,00	0,01	0,00	0,00
SKBNK	TL	ŞEKERBANK T.A.Ş.			TRASKBNK91N8			100.000,00	1,090000	30/04/21					1,090000	109.000,00	0,46	0,09	0,04
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			235.100,00	12,421705	30/04/21					12,100000	2.844.710,00	12,00	2,39	1,04
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			-150.900,00	12,414810	30/04/21					12,100000	-1.825.890,00	-7,70	-1,54	-0,67

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Nisan-2021																			
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)
TOASO	TL	A.Ş. TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI			TRATOASO91H3			177.100,00	29,299576	30/04/21					29,840000	5.284.664,00	22,29	4,44	1,93
TOASO	TL	A.Ş. TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI			TRATOASO91H3			-156.800,00	29,391950	30/04/21					29,840000	-4.678.912,00	-19,74	-3,94	-1,71
TRGYO	TL	A.Ş. TORUNLAR GAYRİMEN KUL YATIRIM ORTAKLIĞI			TRETRGY00018			69.500,00	3,559178	30/04/21					3,570000	248.115,00	1,05	0,21	0,09
TRGYO	TL	A.Ş. TORUNLAR GAYRİMEN KUL YATIRIM ORTAKLIĞI			TRETRGY00018			25.600,00	3,605868	30/04/21					3,570000	91.392,00	0,39	0,08	0,03
TURSG	TL	A.Ş. TÜRKİYE SİGORTA			TURSG			146.400,00	5,543005	30/04/21					5,640000	825.696,00	3,48	0,69	0,30
TURSG	TL	A.Ş. TÜRKİYE SİGORTA			TURSG			53.600,00	5,617640	30/04/21					5,640000	302.304,00	1,28	0,25	0,11
ULKER	TL	A.Ş. ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ			TREULKR00015			187.200,00	21,796094	30/04/21					22,000000	4.118.400,00	17,37	3,46	1,50
ULKER	TL	A.Ş. ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ			TREULKR00015			-87.200,00	21,809041	30/04/21					22,000000	-1.918.400,00	-8,09	-1,61	-0,70
VESTL	TL	A.Ş. VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET			TRAVESTL91H6			55.000,00	30,133950	30/04/21					28,800000	1.584.000,00	6,68	1,33	0,58
VESTL	TL	A.Ş. VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET			TRAVESTL91H6			-34.400,00	30,153262	30/04/21					28,800000	-990.720,00	-4,18	-0,83	-0,36
YKBNK	TL	A.Ş. YAPI VE KREDİ BANKASI			TRAYKBNK91N6			1.125.000,00	2,142880	29/04/21					2,100000	2.362.500,00	9,97	1,99	0,86
YKBNK	TL	A.Ş. YAPI VE KREDİ BANKASI			TRAYKBNK91N6			-1.050.000,00	2,142880	30/04/21					2,100000	-2.205.000,00	-9,30	-1,85	-0,80
HEKTS.R	TL	A.Ş. HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E5			59.200,00	17,379430	30/04/21					12,579000	744.676,80	3,14	0,63	0,27
HEKTS.R	TL	A.Ş. HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E5			-7.000,00	17,379430	30/04/21					12,579000	-88.053,00	-0,37	-0,07	-0,03
GRUP TOPLAMI								3.322.124,19								23.704.170,68	100,00	19,96	8,67
GRUP TOPLAMI								3.322.124,19								23.704.170,68	100,00	19,96	8,67
T.REPO																			
TRT090621T18	TL	HAZİNE	03/05/21	0	TRT090621T18	19,45		45.071.938,36	19,450000	30/04/21		47.313.165,00	74204776	45.071.938,36	19,450000	45.071.938,36	100,00	37,88	16,44
GRUP TOPLAMI								45.071.938,36								45.071.938,36	100,00	37,88	16,44
GRUP TOPLAMI								45.071.938,36								45.071.938,36	100,00	37,88	16,44
TPP																			
TPP			03/05/21	0		19,65		1.001.615,07	19,650000	30/04/21			85038	1.001.615,07	19,650000	1.001.615,07	56,85	0,84	0,37
TPP			03/05/21	0		20,00		760.247,67	20,000000	30/04/21			85221	760.247,67	20,000000	760.247,67	43,15	0,64	0,28
GRUP TOPLAMI								1.761.862,74								1.761.862,74	100,00	1,48	0,65
GRUP TOPLAMI								1.761.862,74								1.761.862,74	100,00	1,48	0,65
TÜREV																			
Futures																			
Kısa																			
F_ALKIM0521	TL				F_ALKIM0521			500,00	17,170000	30/04/21					17,600000	880.000,00	0,00	0,00	0,00
F_ASELS0521	TL				F_ASELS0521			1.750,00	15,330000	27/04/21					15,270000	2.672.250,00	0,00	0,00	0,00
F_DOHOL0521	TL				F_DOHOL0521			4.000,00	2,940000	27/04/21					3,000000	1.200.000,00	0,00	0,00	0,00
F_ECILC0521	TL				F_ECILC0521			2.196,00	6,460000	30/04/21					6,550000	1.438.380,00	0,00	0,00	0,00
F_ENKAI0521	TL				F_ENKAI0521			105,00	7,760000	29/04/21					8,020000	84.210,00	0,00	0,00	0,00
F_HEKTS0521N1	TL				F_HEKTS0521N1			572,00	8,330000	30/04/21					8,330000	1.701.019,32	0,00	0,00	0,00
F_IPEKE0521	TL				F_IPEKE0521			880,00	12,530000	30/04/21					12,940000	1.138.720,00	0,00	0,00	0,00
F_ISFIN0521	TL				F_ISFIN0521			1.928,00	3,290000	30/04/21					3,400000	655.520,00	0,00	0,00	0,00
F_ISGYO0521	TL				F_ISGYO0521			2.000,00	1,930000	30/04/21					1,900000	380.000,00	0,00	0,00	0,00
F_KARSN0521	TL				F_KARSN0521			1.423,00	3,480000	29/04/21					3,400000	483.820,00	0,00	0,00	0,00
F_KCHOL0521	TL				F_KCHOL0521			927,00	18,860000	29/04/21					18,670000	1.730.709,00	0,00	0,00	0,00
F_KOZAA0521	TL				F_KOZAA0521			560,00	13,850000	29/04/21					14,060000	787.360,00	0,00	0,00	0,00
F_MGROS0521	TL				F_MGROS0521			201,00	37,650000	29/04/21					37,220000	748.122,00	0,00	0,00	0,00
F_ODAS0521	TL				F_ODAS0521			4.128,00	2,400000	30/04/21					2,520000	1.040.256,00	0,00	0,00	0,00
F_SISE0521	TL				F_SISE0521			4.000,00	7,410000	28/04/21					7,510000	3.004.000,00	0,00	0,00	0,00
F_SKBNK0521	TL				F_SKBNK0521			1.024,00	1,130000	30/04/21					1,120000	114.688,00	0,00	0,00	0,00
F_SOKM0521	TL				F_SOKM0521			842,00	12,390000	29/04/21					12,360000	1.040.712,00	0,00	0,00	0,00
F_TOASO0521	TL				F_TOASO0521			203,00	30,580000	29/04/21					30,220000	613.466,00	0,00	0,00	0,00
F_TRGYO0521	TL				F_TRGYO0521			951,00	3,650000	29/04/21					3,650000	347.115,00	0,00	0,00	0,00
F_TURSG0521	TL				F_TURSG0521			2.000,00	5,720000	30/04/21					5,760000	1.152.000,00	0,00	0,00	0,00
F_ULKER0521	TL				F_ULKER0521			1.000,00	21,500000	30/04/21					21,600000	2.160.000,00	0,00	0,00	0,00
F_VESTL0521	TL				F_VESTL0521			206,00	30,390000	30/04/21					29,500000	607.700,00	0,00	0,00	0,00
F_YKBNK0521	TL				F_YKBNK0521			750,00	2,150000	27/04/21					2,140000	160.500,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								32.146,00								24.140.547,32	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								32.146,00								24.140.547,32	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								48.366.221,30								48.366.221,30	100,00	40,68	
GRUP TOPLAMI								48.366.221,30								48.366.221,30	100,00	40,68	
GRUP TOPLAMI								48.366.221,30								48.366.221,30	100,00	40,68	

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

FON PORTFÖY DEĞERİ118.904.193,08100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	118.904.193,08	43,37 %
B-)HAZIR DEĞERLER	55.308,85	0,02 %
C-)ALACAKLAR	241.383.455,32	88,04 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-86.172.390,23	-31,43 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	274.170.567,02	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	655.772,15	0,2392 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	402,88	0,0001 %
Kayda Alma Ücreti	4.983,47	0,0018 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	20.427,53	0,0075 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	182.924,03	0,0667 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	331,53	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.095,04	0,0004 %
Diğer Harcamalar	-1,43	0,0000 %
Otomatik BPP Faiz BSMV	198,11	0,0001 %
	866.133,31	0,3159 %

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	29/04/21	15.373,49	518.932,25
ISCTR	Temmettü	06/04/21	202.192,07	202.192,07
GARAN	Temmettü	07/04/21	102.377,46	102.377,46
ENKAI	Temmettü	15/04/21	123.107,12	123.107,12
KCHOL	Temmettü	16/04/21	409.500,00	409.500,00
DOHOL	Temmettü	30/04/21	134.421,84	134.421,84

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