

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Şubat-2022

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	:	174.124.482,21
E-) Katılma Payı Sayısı	:	114.731.734,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,517666
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,483718
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,29
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	5,56
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	28,69
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	98,36
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	:	-5,26
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,00
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	21,61
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	-14,71
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,16
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)	:	41.782.623,54
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	1.505.644,38

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			700,00	27,339643	28/02/22					24,160000	16.912,00	0,01	0,01	0,01
AEFES	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9			6.600,00	24,242458	28/02/22					24,160000	159.456,00	0,08	0,08	0,09
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			3.485.000,00	7,361607	28/02/22			80100519		7,030000	24.499.550,00	11,58	12,05	14,07
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			92.800,00	0,206027	28/02/22			80100519		7,030000	652.384,00	0,31	0,32	0,37
ALKIM	TL	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			TRAALKIM91E0			6.100,00	17,952084	25/02/22					17,660000	107.726,00	0,05	0,05	0,06
ALKIM	TL	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			TRAALKIM91E0			21.800,00	17,829406	28/02/22					17,660000	384.988,00	0,18	0,19	0,22
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			101.100,00	18,951744	28/02/22			80100519		22,240000	2.248.464,00	1,06	1,11	1,29
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALA R A.Ş.			TREBIMM00018			15.100,00	74,110955	28/02/22					73,100000	1.103.810,00	0,52	0,54	0,63
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALA			TREBIMM00018			9.800,00	71,299988	28/02/22					73,100000	716.380,00	0,34	0,35	0,41

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Şubat-2022

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)
CCOLA	TL	R A.Ş. COCA-COLA İÇECEK A.Ş.			TRECOLA00011			3.000,00	111,374950	25/02/22					108,700000	326.100,00	0,15	0,16	0,19
CCOLA	TL	A.Ş. COCA-COLA İÇECEK A.Ş.			TRECOLA00011			-400,00	111,374950	28/02/22					108,700000	-43.480,00	-0,02	-0,02	-0,02
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.S.			TRADOHOL91Q8			2.101.800,00	2,965196	28/02/22					2,540000	5.338.572,00	2,52	2,63	3,07
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.S.			TRADOHOL91Q8			1.904.400,00	2,326642	28/02/22					2,540000	4.837.176,00	2,29	2,38	2,78
ECILC	TL	EİS ECZACIBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			87.500,00	8,195309	24/02/22			80100519		7,390000	646.625,00	0,31	0,32	0,37
ECILC	TL	EİS ECZACIBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			-37.400,00	8,161963	28/02/22			80100519		7,390000	-276.386,00	-0,13	-0,14	-0,16
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			9.773.900,00	2,269202	28/02/22					1,990000	19.450.061,00	9,19	9,56	11,17
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			-8.200.000,00	2,266273	28/02/22					1,990000	-16.318.000,00	-7,71	-8,02	-9,37
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			226.000,00	13,890488	25/02/22			80100519		13,240000	2.992.240,00	1,41	1,47	1,72
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			-138.400,00	13,818622	25/02/22			80100519		13,240000	-1.832.416,00	-0,87	-0,90	-1,05
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			5.000,00	27,299456	10/02/22					31,080000	155.400,00	0,07	0,08	0,09
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			45.000,00	31,933398	28/02/22					31,080000	1.398.600,00	0,66	0,69	0,80
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			3.080.100,00	10,991407	28/02/22			80100519		11,080000	34.127.508,00	16,13	16,78	19,60
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			TRAGARAN91N1			4.503.800,00	11,213415	28/02/22			80100519		11,080000	49.902.104,00	23,57	24,53	28,66
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			24.700,00	79,557157	28/02/22			80100519		76,100000	1.879.670,00	0,89	0,92	1,08
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			167.900,00	72,017740	28/02/22			80100519		76,100000	12.777.190,00	6,04	6,28	7,34
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			80.500,25	13,921096	28/02/22			80100519		12,910000	1.039.258,23	0,49	0,51	0,60
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			-37.600,00	13,886686	25/02/22			80100519		12,910000	-485.416,00	-0,23	-0,24	-0,28
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.S.			TRAISCTR91N2			1.315.500,00	8,187810	24/02/22					7,960000	10.471.380,00	4,95	5,15	6,01
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.S.			TRAISCTR91N2			591.500,00	7,688665	28/02/22					7,960000	4.708.340,00	2,22	2,31	2,70
ISFIN	TL	İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.			TRAISGEN91P9			468.700,00	3,084885	28/02/22			80100519		2,770000	1.298.299,00	0,61	0,64	0,75
ISFIN	TL	İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.			TRAISGEN91P9			-354.500,00	3,083392	28/02/22			80100519		2,770000	-981.965,00	-0,46	-0,48	-0,56
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			3.344.300,00	4,115980	28/02/22					5,500000	18.393.650,00	8,69	9,04	10,56
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			-1.940.300,00	4,545763	28/02/22					5,500000	-10.671.650,00	-5,04	-5,25	-6,13
KARSN	TL	KARŞAN OTOMOTİV SANAYİİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			530.500,00	3,764471	28/02/22			80100519		3,790000	2.010.595,00	0,95	0,99	1,15
KARSN	TL	KARŞAN OTOMOTİV SANAYİİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			-188.000,00	3,764471	25/02/22			80100519		3,790000	-712.520,00	-0,34	-0,35	-0,41
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			105.000,00	30,999218	28/02/22					31,640000	3.322.200,00	1,57	1,63	1,91
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			-5.000,00	30,999218	28/02/22					31,640000	-158.200,00	-0,07	-0,08	-0,09
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			736.400,00	21,900323	28/02/22					19,620000	14.448.168,00	6,83	7,10	8,30
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			-126.500,00	20,723166	28/02/22					19,620000	-2.481.930,00	-1,17	-1,22	-1,43

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Şubat-2022

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)
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELE Rİ A.Ş.			TREKOAL00014			28.000,00	127,032617	28/02/22					114,500000	3.206.000,00	1,51	1,58	1,84
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELE Rİ A.Ş.			TREKOAL00014			-16.400,00	123,729122	28/02/22					114,500000	-1.877.800,00	-0,89	-0,92	-1,08
KRDMĐ	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMR91G7			10.000,00	12,003085	21/02/22					11,730000	117.300,00	0,06	0,06	0,07
KRDMĐ	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMR91G7			15.000,00	11,713698	28/02/22					11,730000	175.950,00	0,08	0,09	0,10
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			5.000,00	40,739794	28/02/22					36,000000	180.000,00	0,09	0,09	0,10
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			70.600,00	35,343758	28/02/22					36,000000	2.541.600,00	1,20	1,25	1,46
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			2.230.000,99	1,340108	28/02/22					1,300000	2.899.001,29	1,37	1,43	1,66
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			-950.000,00	1,340108	28/02/22					1,300000	-1.235.000,00	-0,58	-0,61	-0,71
OYAKC	TL	OYAK ÇİMENTO A.Ş.			TRAMRDIN91F2			14.900,00	8,190132	24/02/22			80100519		7,260000	108.174,00	0,05	0,05	0,06
OYAKC	TL	OYAK ÇİMENTO A.Ş.			TRAMRDIN91F2			-1.000,00	8,190132	25/02/22			80100519		7,260000	-7.260,00	0,00	0,00	0,00
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			120.500,00	14,848122	28/02/22			80100519		15,540000	1.872.570,00	0,88	0,92	1,08
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			-2.000,00	14,848122	25/02/22			80100519		15,540000	-31.080,00	-0,01	-0,02	-0,02
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			16.700,49	43,132040	28/02/22					46,460000	775.904,77	0,37	0,38	0,45
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			70.800,00	43,745140	28/02/22					46,460000	3.289.368,00	1,55	1,62	1,89
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALA Rİ A.Ş.			TRASISEW91Q3			223.700,00	13,480570	28/02/22			80100519		12,380000	2.769.406,00	1,31	1,36	1,59
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALA Rİ A.Ş.			TRASISEW91Q3			30.300,00	10,166173	25/02/22			80100519		12,380000	375.114,00	0,18	0,18	0,22
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			10.000,00	14,124864	28/02/22					11,300000	113.000,00	0,05	0,06	0,06
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			206.400,00	11,387909	28/02/22					11,300000	2.332.320,00	1,10	1,15	1,34
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			13.500,00	33,959963	28/02/22					33,680000	454.680,00	0,21	0,22	0,26
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			1.200,00	33,483158	28/02/22					33,680000	40.416,00	0,02	0,02	0,02
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			26.200,00	25,531591	28/02/22					25,620000	671.244,00	0,32	0,33	0,39
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			-1.000,00	25,531591	28/02/22					25,620000	-25.620,00	-0,01	-0,01	-0,01
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			TRETKHO00012			2.000,00	23,859785	25/02/22					18,500000	37.000,00	0,02	0,02	0,02
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			TRETKHO00012			-1.000,00	19,020840	28/02/22					18,500000	-18.500,00	-0,01	-0,01	-0,01
TRGYO	TL	TORUNLAR GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRETRGY00018			1.785.400,00	4,959097	28/02/22					5,330000	9.516.182,00	4,50	4,68	5,47
TRGYO	TL	TORUNLAR GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRETRGY00018			-1.696.100,00	4,959097	28/02/22					5,330000	-9.040.213,00	-4,27	-4,45	-5,19
TSKB	TL	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.			TRATSKBW91N0			5.105.000,00	1,502149	28/02/22					1,290000	6.585.450,00	3,11	3,24	3,78
TSKB	TL	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.			TRATSKBW91N0			-4.105.000,00	1,502149	28/02/22					1,290000	-5.295.450,00	-2,50	-2,60	-3,04
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			TRETTLK00013			49.900,00	9,260030	24/02/22					8,660000	432.134,00	0,20	0,21	0,25
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			TRETTLK00013			-4.000,00	9,260031	28/02/22					8,660000	-34.640,00	-0,02	-0,02	-0,02
TUPRS	TL	TUPRAS-TÜRKİYE PETROL RAFİNELERİ A.Ş.			TRATUPRS91E8			10.200,00	172,109876	28/02/22					192,900000	1.967.580,00	0,93	0,97	1,13

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Şubat-2022

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)
TUPRS	TL	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFİNELE Rİ A.Ş.			TRATUPRS91E8			-200,00	172,109876	28/02/22					192,900000	-38.580,00	-0,02	-0,02	-0,02
TURSG	TL	TÜRKİYE SİGORTA A.Ş.			TRAGUSGR91O3			157.400,00	5,016233	28/02/22			80100519		4,350000	684.690,00	0,32	0,34	0,39
TURSG	TL	TÜRKİYE SİGORTA A.Ş.			TRAGUSGR91O3			11.900,00	2,700305	28/02/22			80100519		4,350000	51.765,00	0,02	0,02	0,03
ULKER	TL	ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ A.Ş.			TREULKR00015			65.400,00	17,138300	28/02/22					14,850000	971.190,00	0,46	0,48	0,56
ULKER	TL	ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ A.Ş.			TREULKR00015			-28.500,00	17,138300	28/02/22					14,850000	-423.225,00	-0,20	-0,21	-0,24
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			TREVKFB00019			270.700,00	3,357165	28/02/22					3,340000	904.138,00	0,43	0,45	0,52
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			TREVKFB00019			151.000,00	3,320140	28/02/22					3,340000	504.340,00	0,24	0,25	0,29
VESTL	TL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAVESTL91H6			12.700,00	22,300837	28/02/22					22,520000	286.004,00	0,14	0,14	0,16
VESTL	TL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAVESTL91H6			15.500,00	20,952339	28/02/22					22,520000	349.060,00	0,16	0,17	0,20
GRUP TOPLAMI								25.731.101,73							211.635.056,29	100,00	104,06	121,55	
GRUP TOPLAMI								25.731.101,73							211.635.056,29	100,00	104,06	121,55	
REPO																			
KOZAA			01/03/22	0		18,50		12.506.335,62	18,500000	28/02/22		623.131,00	75408054	12.506.335,62	18,500000	-12.506.335,62	21,46	-6,15	-7,18
GARAN			01/03/22	0		18,50		4.252.154,11	18,500000	28/02/22		380.484,00	75408053	4.252.154,11	18,500000	-4.252.154,11	7,30	-2,09	-2,44
GARAN			01/03/22	0		18,50		20.010.136,99	18,500000	28/02/22		1.790.511,00	75408053	20.010.136,99	18,500000	-20.010.136,99	34,33	-9,84	-11,49
AKBNK			01/03/22	0		18,50		6.503.294,52	18,500000	28/02/22		925.926,00	75408053	6.503.294,52	18,500000	-6.503.294,52	11,16	-3,20	-3,73
EKGYO			01/03/22	0		18,50		15.007.602,74	18,500000	28/02/22		7.500.000,00	75408053	15.007.602,74	18,500000	-15.007.602,74	25,75	-7,38	-8,62
GRUP TOPLAMI								58.279.523,98							-58.279.523,98	100,00	-28,66	-33,46	
GRUP TOPLAMI								58.279.523,98							-58.279.523,98	100,00	-28,66	-33,46	
TÜREV																			
Futures																			
Kısa																			
F_AEFES0322	TL				F_AEFES0322			73,00	27,410000	28/02/22			80105125		24,890000	181.697,00	0,00	0,00	0,00
F_AKBNK0322	TL				F_AKBNK0322			35.778,00	7,350000	28/02/22			80105125		7,020000	25.116.156,00	0,00	0,00	0,00
F_ALKIM0322	TL				F_ALKIM0322			279,00	18,480000	28/02/22			80105125		18,110000	505.269,00	0,00	0,00	0,00
F_ASELS0322	TL				F_ASELS0322			1.000,00	20,870000	24/02/22			80105125		22,780000	2.278.000,00	0,00	0,00	0,00
F_ASELS0422	TL				F_ASELS0422			11,00	21,370000	24/02/22			80105125		23,020000	25.322,00	0,00	0,00	0,00
F_BIMAS0322	TL				F_BIMAS0322			249,00	74,910000	28/02/22			80105125		74,430000	1.853.307,00	0,00	0,00	0,00
F_CCOLA0322	TL				F_CCOLA0322			26,00	111,060000	23/02/22			80105125		110,590000	287.534,00	0,00	0,00	0,00
F_DOHOL0322	TL				F_DOHOL0322			40.000,00	2,680000	28/02/22			80105125		2,620000	10.480.000,00	0,00	0,00	0,00
F_DOHOL0422	TL				F_DOHOL0422			62,00	2,730000	24/02/22			80105125		2,660000	16.492,00	0,00	0,00	0,00
F_ECILC0322	TL				F_ECILC0322			501,00	7,760000	28/02/22			80105125		7,560000	378.756,00	0,00	0,00	0,00
F_EKGYO0322	TL				F_EKGYO0322			15.739,00	2,090000	25/02/22			80105125		2,040000	3.210.756,00	0,00	0,00	0,00
F_ENJSA0322	TL				F_ENJSA0322			876,00	13,710000	25/02/22			80105125		13,640000	1.194.864,00	0,00	0,00	0,00
F_EREGL0322	TL				F_EREGL0322			500,00	27,420000	28/02/22			80105125		27,420000	1.371.000,00	0,00	0,00	0,00
F_GARAN0322	TL				F_GARAN0322			75.100,00	11,720000	28/02/22			80105125		11,460000	86.064.600,00	0,00	0,00	0,00
F_GARAN0422	TL				F_GARAN0422			739,00	11,880000	28/02/22			80105125		11,630000	859.457,00	0,00	0,00	0,00
F_GUBRF0322	TL				F_GUBRF0322			1.926,00	76,900000	28/02/22			80105125		78,350000	15.090.210,00	0,00	0,00	0,00
F_HEKTS0322	TL				F_HEKTS0322			428,00	13,340000	25/02/22			80105125		13,250000	567.100,00	0,00	0,00	0,00
F_HEKTS0422	TL				F_HEKTS0422			1,00	13,780000	24/02/22			80105125		13,500000	1.350,00	0,00	0,00	0,00
F_ISCTR0322	TL				F_ISCTR0322			19.070,00	8,070000	28/02/22			80105125		7,960000	15.179.720,00	0,00	0,00	0,00
F_ISFIN0322	TL				F_ISFIN0322			1.142,00	2,930000	25/02/22			80105125		2,850000	325.470,00	0,00	0,00	0,00
F_ISGYO0322	TL				F_ISGYO0322			14.040,00	5,680000	28/02/22			80105125		5,680000	7.974.720,00	0,00	0,00	0,00
F_KARSN0322	TL				F_KARSN0322			3.425,00	3,990000	25/02/22			80105125		3,850000	1.318.625,00	0,00	0,00	0,00
F_KCHOL0322	TL				F_KCHOL0322			1.000,00	32,280000	24/02/22			80105125		32,250000	3.225.000,00	0,00	0,00	0,00
F_KOZAA0322	TL				F_KOZAA0322			6.099,00	20,560000	28/02/22			80105125		20,160000	12.			

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Şubat-2022																			
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								50.023.889,04								50.023.889,04	100,00	24,60	
GRUP TOPLAMI								50.023.889,04								50.023.889,04	100,00	24,60	
GRUP TOPLAMI								50.023.889,04								50.023.889,04	100,00	24,60	
FON PORTFÖY DEĞERİ																203.379.421,35		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	203.379.421,35	116,80 %
B-)HAZIR DEĞERLER	18.728,89	0,01 %
C-)ALACAKLAR	112.157.884,35	64,41 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-141.431.552,38	-81,22 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	174.124.482,21	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	431.001,20	0,2475 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	3.275,24	0,0019 %
Kayda Alma Ücreti	2.664,28	0,0015 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	13.922,62	0,0080 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	81.512,75	0,0468 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	228,89	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	948,08	0,0005 %
Diğer Harcamalar	-5,12	0,0000 %
BİST KYD Ücreti	1.947,00	0,0011 %
	535.494,94	0,3074 %

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
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

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