

DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
MAYIS 2022

İ-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	:	451.658.480,99
E-) Katılma Payı Sayısı	:	277.195.141.000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.
İİ-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER		
A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1.629388
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1.601622
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	1.73
D-)Yılıbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	13.34
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	31.04
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	129.79
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvilii	:	0.00
d-)Özel Sektör Tahvilii	:	0.00
e-)Kira Sertifikaları	:	0.00
f-)Finansman Bonusu	:	0.00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	-1.59
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	:	24.44
o-)Yatırım Fonu	:	0.00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0.00
r-)Repo-Trepo	:	-52.64
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0.00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0.13
b-)Hazine Bonosu	:	0.00
c-)Devlet Tahvilii	:	0.00
d-)Opsiyon	:	0.00
e-)Varant	:	0.00
f-)Diğer	:	0.00
H-)Portföyün Ortalama Vadesi		
l-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	124,985,096.93
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	12,801,670.15

İİİ-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KIYMET		DÖVİZ ÇİNSİ	İBRAÇCI KURUM		VADE TARİHİ	VADEY E KALAN	ISIN KODU	NOMİNA L FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEM E	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 (FTD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HISSE SENETLERİ																					05/05/2022 21.53
Hisse Türk																					
AEFES	TL		ANADOLU EFES BİRAÇILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9				38,800.00	27.762471	30/05/22					28.280000	1,097,264.00	0.15	0.21	0.24
AEFES	TL		ANADOLU EFES BİRAÇILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9			9,500.00	28.405936	31/05/22						28.280000	268,660.00	0.04	0.05	0.06
AKBNK	TL		AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBKN91N6			7,279,200.00	6.072506	31/05/22				801005112890194370020		8.360000	60,854,112.00	8.25	11.58	13.47
AKBNK	TL		AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBKN91N6			2,925,000.00	8.186816	30/05/22				801005112890194370020		8.360000	24,453,000.00	3.33	4.65	5.41
ALKIM	TL		ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			TRAAALKIMS1E0			50,500.00	21.188967	30/05/22						22.620000	1,142,310.00	0.16	0.22	0.25
ALKIM	TL		ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.			TRAAALKIMS1E0			-400.00	21.188967	31/05/22						22.620000	-9,048.00	0.00	0.00	0.00
ASELS	TL		ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			108,700.00	23.075896	31/05/22				801005112960057970020		24.460000	2,658,802.00	0.36	0.51	0.59
ASELS	TL		ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			415,400.00	24.212849	31/05/22				801005112960057970020		24.460000	10,160,684.00	1.38	1.93	2.25
DOHOL	TL		DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			1,072,600.00	3.713782	31/05/22						4.010000	4,301,126.00	0.59	0.82	0.95
DOHOL	TL		DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			1,150,000.00	3.961863	31/05/22				801005112968816260020		4.010000	4,611,500.00	0.63	0.88	1.02
ECLIC	TL		EİS ECZACIBAŞI LAÇ, SİĞİRİ VE FİNAKSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECLCS1E0			98,400.00	9.750006	30/05/22						9.620000	946,608.00	0.13	0.18	0.21
ECLIC	TL		EİS ECZACIBAŞI LAÇ, SİĞİRİ VE FİNAKSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECLCS1E0			51,500.00	9.738799	31/05/22						9.620000	495,430.00	0.07	0.09	0.11
EKGYO	TL		EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			2,495,900.00	2.670591	31/05/22				801005112890008390020		2.870000	7,166,103.00	0.98	1.36	1.59
EKGYO	TL		EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			1,615,200.00	2.678392	30/05/22				801005112890008390020		2.870000	4,635,624.00	0.63	0.88	1.03
ENUSA	TL		ENURJISA ENERJİ A.Ş.			TREENUSA00014			1,380,900.00	14.352439	31/05/22						14.800000	20,437,320.00	2.79	3.88	4.52
ENUSA	TL		ENURJISA ENERJİ A.Ş.			TREENUSA00014			-633,800.00	14.352490	31/05/22						14.800000	-9,380,240.00	-1.28	-1.78	-2.08
EREGL	TL		EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TTRAERGL91G3			509,500.00	31.931132	31/05/22				801005112868140480020		34.200000	17,424,900.00	2.38	3.31	3.86
EREGL	TL		EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TTRAERGL91G3			-5,000.00	31.931132	30/05/22				801005112868140480020		34.200000	-171,000.00	-0.02	-0.03	-0.04
FROTO	TL		FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAFOTOSN61H6			3,200.00	277.946875	24/05/22				801005112953999420020		309.600000	990,720.00	0.14	0.19	0.22
FROTO	TL		FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.			TRAFOTOSN61H6			-2,700.00	294.966000	31/05/22				801005112953999420020		309.600000	-835,920.00	-0.11	-0.16	-0.19
GUBRF	TL		GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			310,900.00	78.586281	31/05/22						76.700000	23,846,030.00	3.25	4.53	5.28
GUBRF	TL		GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			86,400.00	74.621478	31/05/22				801005112943116720020		76.700000	6,626,880.00	0.90	1.26	1.47
HALKB	TL		T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			504,801.00	5.222865	31/05/22						5.790000	2,930,735.88	0.40	0.56	0.65
Tem.Ver. HALKB	TL		T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			3,713,299.00	5.222865	31/05/22				801005112770528280020		5.790000	21,492,063.12	2.93	4.08	4.80
HEKTS	TL		HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS1E4			87,700.25	25.125957	25/05/22						31.320000	2,746,771.83	0.37	0.52	0.61
HEKTS	TL		HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS1E4			-12,700.00	25.125957	31/05/22				801005112967659700020		31.320000	-397,764.00	-0.05	-0.08	-0.09
ISCTR	TL		T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			2,900,000.00	10.023173	31/05/22						10.830000	31,407,000.00	4.28	5.97	6.95
ISCTR	TL		T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			320,600.00	10.537193	30/05/22				801005112900395490020		10.830000	3,472,098.00	0.47	0.66	0.77
ISFIN	TL		İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.			TRAISGEN91P9			770,600.00	3.739833	31/05/22				801005112960021670020		3.900000	3,005,340.00	0.41	0.57	0.67
ISFIN	TL		İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.			TRAISGEN91P9			2,689,900.00	3.884809	31/05/22				801005112960021670020		3.900000	10,490,610.00	1.43	1.99	2.32
ISGYO	TL		İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			2,302,000.00	13.884941	31/05/22						14.750000	33,954,500.00	4.63	6.45	7.52
ISGYO	TL		İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			1,773,900.00	14.043096	31/05/22						14.750000	26,165,025.00	3.57	4.97	5.79
KARSN	TL		KARSAŖ OTOMOTİV SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARASN61H7			1,165,600.00	5.429882	31/05/22				801005112943351720020		6.990000	8,147,544.00	1.11	1.55	1.80
KARSN	TL		KARSAŖ OTOMOTİV SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARASN61H7			334,400.00	6.448770	31/05/22				801005112943351720020		6.990000	2,337,456.00	0.32	0.44	0.52
KOCHOL	TL		KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKOCHOL91Q8			415,200.00	38.848737	31/05/22						40.980000	17,014,896.00	2.32	3.23	3.77
KOCHOL	TL		KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKOCHOL91Q8			18,000.00	40.078150	30/05/22				801005112868611170020		40.980000	737,640.00	0.10	0.14	0.16
KOZAA	TL		KOZA ANADOLU METAL MADENÇİLİK			TREKOZAO00014			570,400.00	31.002870	31/05/22						30.320000	17,284,523.00	2.36	3.29	3.83
KOZAA	TL		KOZA ANADOLU METAL MADENÇİLİK			TREKOZAO00014			-5,000.00	31.002870	31/05/22				801005112962523140020		30.320000	-151,600.00	-0.02	-0.03	-0.03
KOZAL	TL		KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.			TREKOAL00014			4,800.00	57.988825	26/05/22						197.200000	946,560.00	0.13	0.18	0.21
KOZAL	TL		KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.			TREKOAL00014			45,200.00	196.741913	31/05/22						197.200000	8,913,440.00	1.21	1.69	1.97
KRDMO	TL		KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMRS1G7			2,297,100.00	14.229428	31/05/22				801005112907042470020		14.700000	33,767,370.00	4.60	6.42	7.48
KRDMO	TL		KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMRS1G7			490,900.00	14.742644	30/05/22				801005112907042470020		14.700000	7,216,230.00	0.98	1.37	1.60
MGROS	TL		MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTR00012			117,900.00	42.888416	27/05/22						44.300000	5,222,970.00	0.71	0.99	1.16
MGROS	TL		MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTR00012			-6,500.00	42.974349	31/05/22						44.300000	-287,950.00	-0.04	-0.06	-0.06
ODAS	TL		ODAS ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC. A.Ş.			TREODAS00014			16,960,000.00	2.277600	31/05/22						2.750000	46,640,002.72	6.36	8.86	10.33
ODAS	TL		ODAS ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC. A.Ş.			TREODAS00014			-6,541,200.00	2.413300	31/05/22						2.750000	-17,988,300.00	-2.45	-3.42	-3.98
OKAYMC	TL		OKYAK ÇİMENTO A.Ş.			TRAOKRDM91F2			1,837,800.00	10.989150	31/05/22				801005112844866900020		12.180000	22,384,404.00	3.05	4.25	4.96
OKAYMC	TL		OKYAK ÇİMENTO A.Ş.			TRAOKRDM91F2			-784,600.00	10.989257	31/05/22				801005112844866900020		12.180000	-9,678,228.00	-1.32	-1.84	-2.14
PETKİM	TL		PETKİM PETROLKİMYA HOLDİNG A.Ş.			TRAPEYKMS1E0			103,900.00	9.448435	27/05/22						9.920000	1,035,688.00	0.14	0.20	0.23
SAHOL	TL		HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			2,052,300.00	20.169074	31/05/22				801005112959905770020		21.220000	43,549,806.00	5.94	8.27	9.64
SAHOL	TL		HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			950,000.00	21.207447	31/05/22				801005112959905770020		21.220000	20,159,000.00	2.75	3.83	4.46
SASA	TL		SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			36,700.98	31.979957	30/05/22						36.480000	1,338,851.75	0.18	0.25	0.30
SASA	TL		SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			-2,000.00	31.979957	31/05/22						36.480000	-72,960.00	-0.01	-0.01	-0.02
SISE	TL		TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			967,200.00	19.809432	31/05/22				801005112861552560020		20.980000	20,291,856.00	2.77	3.86	4.49
SISE	TL		TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			432,800.00	21.032942	30/05/22				801005112861552560020		20.980000	9,080,144.00	1.24	1.73	2.01
SKBNK	TL		ŞEKERBANK T.A.Ş.			TRASKBKN91N8			8,127,900.00	1.313693	31/05/22						1.280000	10,403,712.00	1.42	1.98	2.30
SKBNK	TL		ŞEKERBANK T.A.Ş.			TRASKBKN91N8			57,000.00	1.231987	30/05/22						1.280000	72,960.00	0.01	0.01	0.02
SOKM	TL		SOK MARMERLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			307,600.00	12.958124	31/05/22						13.390000	4,118,764.00	0.56		

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
SASA	Bedelsiz Sermaye Artırımı	09/05/22	95,700.49	3,051,215.69
AEFES	Temmettû	24/05/22	741.80	741.80
ECILC	Temmettû	26/05/22	7,533.60	7,533.60
GARAN	Temmettû	27/05/22	62,253.84	62,253.84

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