

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Ocak-2024

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	:	234.688.098,98
E-) Katılma Payı Sayısı	:	76.303.431,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Mart 2020
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	3,075721
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	2,968829
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,60
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	3,60
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	44,98
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	23,86
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	:	-0,29
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	1,19
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	5,02
o-)Yatırım Fonu	:	74,62
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	-4,40
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	5,02
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	7,57
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	125.997,10
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	35.462.012,23

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			19.000,00	137,011382	31/01/24			80100512		140,800000	2.675.200,00	1,40	1,71	1,14
AEFES	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9			8.400,00	146,628805	31/01/24			80100512		140,800000	1.182.720,00	0,62	0,75	0,50
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			389.300,00	40,255395	31/01/24			80100512		39,540000	15.392.922,00	8,04	9,81	6,56
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			74.700,00	38,492704	31/01/24			80100512		39,540000	2.953.638,00	1,54	1,88	1,26
AKSEN	TL	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.			TREAKSN00011			8.400,00	35,439170	31/01/24			80100512		36,040000	302.736,00	0,16	0,19	0,13
AKSEN	TL	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.			TREAKSN00011			-400,00	35,870598	31/01/24			80100512		36,040000	-14.416,00	-0,01	-0,01	-0,01
ALARK	TL	ALARKO HOLDİNG A.Ş.			TRAAALARK91Q0			36.900,00	103,199043	31/01/24			80100512		107,300000	3.959.370,00	2,07	2,52	1,69
ALARK	TL	ALARKO HOLDİNG A.Ş.			TRAAALARK91Q0			-13.100,00	105,007016	31/01/24			80100512		107,300000	-1.405.630,00	-0,73	-0,90	-0,60
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.			TRAARCLK91H5			11.400,00	139,689075	31/01/24					141,600000	1.614.240,00	0,84	1,03	0,69
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.			TRAARCLK91H5			-10.400,00	140,983220	31/01/24					141,600000	-1.472.640,00	-0,77	-0,94	-0,63

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Ocak-2024																			
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)
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			149.300,00	49,161063	31/01/24			80100512		50,600000	7.554.580,00	3,94	4,82	3,22
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAASELS91H2			-124.300,00	49,555245	31/01/24			80100512		50,600000	-6.289.580,00	-3,28	-4,01	-2,68
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			884.200,00	12,590752	31/01/24			80100512		13,230000	11.697.966,00	6,11	7,46	4,98
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.			TRADOHOL91Q8			-606.200,00	12,846980	31/01/24			80100512		13,230000	-8.020.026,00	-4,19	-5,11	-3,42
ECILC	TL	EİS ECZACİBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			32.100,00	46,715675	31/01/24			80100512		47,140000	1.513.194,00	0,79	0,96	0,64
ECILC	TL	EİS ECZACİBAŞI İLAÇ, SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAECILC91E0			-15.800,00	47,105888	31/01/24			80100512		47,140000	-744.812,00	-0,39	-0,48	-0,32
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			8.719.000,00	9,955418	31/01/24			80100512		10,050000	87.625.950,00	45,73	55,89	37,34
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TREEGYO00017			-6.739.000,00	10,012981	31/01/24			80100512		10,050000	-67.726.950,00	-35,36	-43,17	-28,86
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			48.900,00	52,284038	31/01/24			80100512		55,650000	2.721.285,00	1,42	1,74	1,16
ENJSA	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.			TREENSA00014			-44.300,00	53,114080	31/01/24			80100512		55,650000	-2.465.295,00	-1,29	-1,57	-1,05
ENKAI	TL	ENKA İNSAAT VE SANAYİ A.Ş.			TREENKA00011			29.100,00	35,875986	31/01/24			80100512		37,260000	1.084.266,00	0,57	0,69	0,46
ENKAI	TL	ENKA İNSAAT VE SANAYİ A.Ş.			TREENKA00011			-26.500,00	36,354023	31/01/24			80100512		37,260000	-987.390,00	-0,52	-0,63	-0,42
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			75.500,00	42,716108	31/01/24			80100512		43,140000	3.257.070,00	1,70	2,08	1,39
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			149.400,00	43,456781	31/01/24			80100512		43,140000	6.445.116,00	3,37	4,11	2,75
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			244.900,00	13,009672	31/01/24					13,030000	3.191.047,00	1,67	2,03	1,36
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			-124.600,00	13,029195	31/01/24					13,030000	-1.623.538,00	-0,85	-1,04	-0,69
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			57.000,36	17,525425	31/01/24					17,820000	1.015.746,42	0,53	0,65	0,43
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			TRAHEKTS91E4			-57.000,00	17,638889	31/01/24					17,820000	-1.015.740,00	-0,53	-0,65	-0,43
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			511.300,62	25,117238	31/01/24			80100512		25,640000	13.109.747,90	6,84	8,36	5,59
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.			TRAISCTR91N2			296.800,00	25,736346	31/01/24			80100512		25,640000	7.609.952,00	3,97	4,85	3,24
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			7.800,00	18,622315	31/01/24			80100512		17,880000	139.464,00	0,07	0,09	0,06
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			TRAISGYO91Q3			29.200,00	17,835759	31/01/24			80100512		17,880000	522.096,00	0,27	0,33	0,22
KARSN	TL	KARSAN OTOMOTİV SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			500,00	9,406800	31/01/24			80100512		9,610000	4.805,00	0,00	0,00	0,00
KARSN	TL	KARSAN OTOMOTİV SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN91H7			15.800,00	9,577004	31/01/24			80100512		9,610000	151.838,00	0,08	0,10	0,06
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			64.600,00	153,611685	31/01/24			80100512		160,700000	10.381.220,00	5,42	6,62	4,42
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			-28.600,00	157,207502	31/01/24			80100512		160,700000	-4.596.020,00	-2,40	-2,93	-1,96
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			97.000,00	48,322514	31/01/24			80100512		49,200000	4.772.400,00	2,49	3,04	2,03
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK			TREKOZA00014			-37.600,00	48,879722	31/01/24			80100512		49,200000	-1.849.920,00	-0,97	-1,18	-0,79
KRDM	TL	KARDEMİR			TRAKRDMR91G7			196.601,00	25,863185	31/01/24			80100512		26,840000	5.276.770,84	2,76	3,36	2,25

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON																			
Ocak-2024																			
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)
KRDMD	TL	KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D) KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			TRAKRDMR91G7			-162.600,00	26,803473	31/01/24			80100512		26,8400000	-4.364.184,00	-2,28	-2,78	-1,86
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş. (D) MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			200,00	399,416650	31/01/24					408,5000000	81.700,00	0,04	0,05	0,03
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.			TREMGTI00012			11.900,00	408,478992	31/01/24					408,5000000	4.861.150,00	2,54	3,10	2,07
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			38.400,99	9,358033	31/01/24					9,2700000	355.977,18	0,19	0,23	0,15
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.			TREODAS00014			676.100,00	9,260836	31/01/24					9,2700000	6.267.447,00	3,27	3,99	2,67
PETKM	TL	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.			TRAPETKM91E0			5.100,00	20,835337	31/01/24			80100512		21,7200000	110.772,00	0,06	0,07	0,05
PETKM	TL	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.			TRAPETKM91E0			64.800,00	21,973813	31/01/24			80100512		21,7200000	1.407.456,00	0,73	0,90	0,60
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			9.200,00	753,572163	31/01/24			80100512		752,5000000	6.923.000,00	3,61	4,41	2,95
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			175.600,00	69,872970	31/01/24			80100512		72,6000000	12.748.560,00	6,66	8,13	5,43
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			-41.100,00	72,098921	31/01/24			80100512		72,6000000	-2.983.860,00	-1,56	-1,90	-1,27
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			111.900,00	37,938801	31/01/24			80100512		38,5000000	4.308.150,00	2,25	2,75	1,84
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.			TRASASAW91E4			-96.800,00	38,432611	31/01/24			80100512		38,5000000	-3.726.800,00	-1,95	-2,38	-1,59
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			54.500,00	48,332607	31/01/24					49,3000000	2.686.850,00	1,40	1,71	1,14
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			TRASISEW91Q3			25.500,00	50,823562	31/01/24					49,3000000	1.257.150,00	0,66	0,80	0,54
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			3.600,00	62,007847	31/01/24			80100512		63,8000000	229.680,00	0,12	0,15	0,10
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00022			8.900,00	63,165588	31/01/24			80100512		63,8000000	567.820,00	0,30	0,36	0,24
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			16.400,00	131,941844	31/01/24					138,3000000	2.268.120,00	1,18	1,45	0,97
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			1.600,00	178,266763	31/01/24					138,3000000	221.280,00	0,12	0,14	0,09
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			161.200,00	68,148715	31/01/24			80100512		68,5500000	11.050.260,00	5,77	7,04	4,71
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			-1.500,00	68,599369	31/01/24			80100512		68,5500000	-102.825,00	-0,05	-0,07	-0,04
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			14.700,00	252,686297	31/01/24			80100512		272,7500000	4.009.425,00	2,09	2,56	1,71
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			38.800,00	274,239006	31/01/24			80100512		272,7500000	10.582.700,00	5,53	6,75	4,51
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			TRETKHO00012			36.000,00	39,738038	31/01/24			80100512		41,7800000	1.504.080,00	0,79	0,96	0,64
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			TRETKHO00012			5.800,00	41,995138	31/01/24			80100512		41,7800000	242.324,00	0,13	0,15	0,10
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			10.600,00	239,358122	31/01/24			80100512		246,4000000	2.611.840,00	1,36	1,67	1,11
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			12.800,00	252,967259	31/01/24			80100512		246,4000000	3.153.920,00	1,65	2,01	1,34
TSKB	TL	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.			TRATSKBW91N0			449.900,00	7,778184	31/01/24			80100512		8,2000000	3.689.180,00	1,93	2,35	1,57
TSKB	TL	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.			TRATSKBW91N0			-89.300,00	7,958212	31/01/24			80100512		8,2000000	-732.260,00	-0,38	-0,47	-0,31
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			TRETTLK00013			199.500,00	31,957948	31/01/24			80100512		32,7000000	6.523.650,00	3,41	4,16	2,78
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			TRETTLK00013			-17.100,00	32,474953	31/01/24			80100512		32,7000000	-559.170,00	-0,29	-0,36	-0,24

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Ocak-2024

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)	
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			TREVKFB00019			340.700,00	14,179443	31/01/24			80100512		14,160000	4.824.312,00	2,52	3,07	2,06	
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			TREVKFB00019			-127.700,00	14,214408	31/01/24			80100512		14,160000	-1.808.232,00	-0,94	-1,15	-0,77	
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			TRAYKBNK91N6			750.100,00	21,736269	31/01/24			80100512		21,840000	16.382.184,00	8,55	10,44	6,98	
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			TRAYKBNK91N6			-45.900,00	21,711819	31/01/24			80100512		21,840000	-1.002.456,00	-0,52	-0,64	-0,43	
GRUP TOPLAMI								6.971.102,97								191.532.583,34	100,00	122,10	81,58	
GRUP TOPLAMI								6.971.102,97								191.532.583,34	100,00	122,10	81,58	
REPO																				
SAHOL			01/02/24	0		44,50		19.724.017,81	44,500000	31/01/24		27,00	78186822	19.724.017,81	44,500000	-19.724.017,81	21,96	-12,57	-8,40	
EKGYO			01/02/24	0		44,50		50.060.958,90	44,500000	31/01/24		5.000.000,00	78186822	50.060.958,90	44,500000	-50.060.958,90	55,74	-31,91	-21,33	
AKBNK			01/02/24	0		44,50		20.024.383,56	44,500000	31/01/24		515,00	78186822	20.024.383,56	44,500000	-20.024.383,56	22,30	-12,77	-8,53	
GRUP TOPLAMI								89.809.360,27								-89.809.360,27	100,00	-57,25	-38,26	
GRUP TOPLAMI								89.809.360,27								-89.809.360,27	100,00	-57,25	-38,26	
TPP BORÇLANMA																				
TPP BORÇLANMA																				
TPP			01/02/24	0		44,15		-9.861.914,45	44,150000	31/01/24			35309	-9.861.914,45	44,150000	-9.861.914,45	100,00	-6,29	-4,20	
GRUP TOPLAMI								-9.861.914,45								-9.861.914,45	100,00	-6,29	-4,20	
GRUP TOPLAMI								-9.861.914,45								-9.861.914,45	100,00	-6,29	-4,20	
TÜREV																				
Futures																				
Kısa																				
F_AEFES0224	TL				F_AEFES0224			274,00	148,100000	31/01/24			80105125		148,100000	4.057.940,00	0,00	0,00	0,00	
F_AKBNK0224	TL				F_AKBNK0224			4.640,00	41,190000	31/01/24			80105125		41,130000	19.084.320,00	0,00	0,00	0,00	
F_AKSEN0224	TL				F_AKSEN0224			80,00	37,390000	31/01/24			80105125		37,390000	299.120,00	0,00	0,00	0,00	
F_ALARK0224	TL				F_ALARK0224			238,00	111,150000	31/01/24			80105125		111,150000	2.645.370,00	0,00	0,00	0,00	
F_ARCLK0224	TL				F_ARCLK0224			10,00	146,090000	31/01/24			80105125		146,090000	146.090,00	0,00	0,00	0,00	
F_ASELS0224	TL				F_ASELS0224			250,00	52,620000	31/01/24			80105125		52,620000	1.315.500,00	0,00	0,00	0,00	
F_DOHOL0224	TL				F_DOHOL0224			2.780,00	13,760000	31/01/24			80105125		13,720000	3.814.160,00	0,00	0,00	0,00	
F_ECILC0224	TL				F_ECILC0224			163,00	49,200000	31/01/24			80105125		49,200000	801.960,00	0,00	0,00	0,00	
F_EKGYO0224	TL				F_EKGYO0224			19.800,00	10,540000	31/01/24			80105125		10,440000	20.671.200,00	0,00	0,00	0,00	
F_ENJSA0224	TL				F_ENJSA0224			46,00	56,940000	31/01/24			80105125		56,940000	261.924,00	0,00	0,00	0,00	
F_ENKAI0224	TL				F_ENKAI0224			26,00	38,720000	31/01/24			80105125		38,720000	100.672,00	0,00	0,00	0,00	
F_EREGL0224	TL				F_EREGL0224			2.249,00	44,870000	31/01/24			80105125		44,870000	10.091.263,00	0,00	0,00	0,00	
F_HALKB0224	TL				F_HALKB0224			1.203,00	13,550000	31/01/24			80105125		13,550000	1.630.065,00	0,00	0,00	0,00	
F_ISCTR0224	TL				F_ISCTR0224			8.081,00	26,610000	31/01/24			80105125		26,580000	21.479.298,00	0,00	0,00	0,00	
F_ISGYO0224	TL				F_ISGYO0224			370,00	18,590000	31/01/24			80105125		18,590000	687.830,00	0,00	0,00	0,00	
F_KARSN0224	TL				F_KARSN0224			163,00	10,050000	31/01/24			80105125		10,050000	163.815,00	0,00	0,00	0,00	
F_KCHOL0224	TL				F_KCHOL0224			360,00	167,080000	31/01/24			80105125		167,080000	6.014.880,00	0,00	0,00	0,00	
F_KOZAA0224	TL				F_KOZAA0224			594,00	50,950000	31/01/24			80105125		50,950000	3.026.430,00	0,00	0,00	0,00	
F_KRDM0224	TL				F_KRDM0224			340,00	27,990000	31/01/24			80105125		27,990000	951.660,00	0,00	0,00	0,00	
F_MGROS0224	TL				F_MGROS0224			121,00	425,450000	31/01/24			80105125		425,450000	5.147.945,00	0,00	0,00	0,00	
F_ODAS0224	TL				F_ODAS0224			7.145,00	9,530000	31/01/24			80105125		9,650000	6.894.925,00	0,00	0,00	0,00	
F_PETKM0224	TL				F_PETKM0224			699,00	22,600000	31/01/24			80105125		22,600000	1.579.740,00	0,00	0,00	0,00	
F_PGSUS0224	TL				F_PGSUS0224			92,00	784,980000	31/01/24			80105125		783,690000	7.209.948,00	0,00	0,00	0,00	
F_SAHOL0224	TL				F_SAHOL0224			1.345,00	76,560000	31/01/24			80105125		75,470000	10.150.715,00	0,00	0,00	0,00	
F_SASA0224	TL				F_SASA0224			151,00	39,970000	31/01/24			80105125		39,970000	603.547,00	0,00	0,00	0,00	
F_SISE0224	TL				F_SISE0224			800,00	51,330000	31/01/24			80105125		51,330000	4.106.400,00	0,00	0,00	0,00	
F_SOKM0224	TL				F_SOKM0224			125,00	66,440000	31/01/24			80105125		66,440000	830.500,00	0,00	0,00	0,00	
F_TAVHL0224	TL				F_TAVHL0224			180,00	143,550000	31/01/24			80105125		143,550000	2.583.900,00	0,00	0,00	0,00	
F_TCELL0224	TL				F_TCELL0224			1.597,00	71,980000	31/01/24			80105125		71,030000	11.343.491,00	0,00	0,00	0,00	
F_THYAO0224	TL				F_THYAO0224			535,00	282,490000	31/01/24			80105125		283,320000	15.157.620,00	0,00	0,00	0,00	
F_TKFEN0224	TL				F_TKFEN0224			418,00	40,950000	31/01/24			80105125		43,520000	1.819.136,00	0,00	0,00	0,00	
F_TOASO0224	TL				F_TOASO0224			234,00	256,250000	31/01/24			80105125		256,250000	5.996.250,00	0,00	0,00	0,00	
F_TSKB0224	TL				F_TSKB0224			3.606,00	8,540000	31/01/24			80105125		8,540000	3.079.524,00	0,00	0,00	0,00	
F_TTKOM0224	TL				F_TTKOM0224			1.824,00	34,230000	31/01/24			80105125		33,980000	6.197.952,00	0,00	0,00	0,00	
F_VAKBN0224	TL				F_VAKBN0224			2.130,00	14,910000	31/01/24			80105125		14,710000	3.133.230,00	0,00	0,00	0,00	
F_YKBNK0224	TL				F_YKBNK0224			7.042,00	22,440000	31/01/24			80105125		22,660000	15.957.172,00	0,00	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								69.711,00								199.035.492,00	0,00	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								69.711,00								199.035.492,00	0,00	0,00	0,00	
VIOP Nakit Teminatı																				
VIOP Nakit Teminatı								65.008.423,58								65.008.423,58	100,00	41,44		
GRUP TOPLAMI								65.008.423,58								65.008.423,58	100,00	41,44		
GRUP TOPLAMI								65.008.423,58								65.008.423,58	100,00	41,44		
FON PORTFÖY DEĞERİ																156.869.732,20			100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

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

DPI-DENİZ PORT. İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Ocak-2024

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	156.869.732,20	66,84 %
B-)HAZIR DEĞERLER	121.320,68	0,05 %
C-)ALACAKLAR	378.736.522,96	161,38 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-301.039.476,96	-128,27 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	234.688.098,98	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER		
AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Yönetim Ücreti	620.413,17	0,2644 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	380,40	0,0002 %
Kayda Alma Ücreti	3.884,99	0,0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	26.588,17	0,0113 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	141.266,51	0,0602 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	316,26	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.015,80	0,0004 %
BİST KYD Ücreti	3.502,24	0,0015 %
	797.367,54	0,3398 %

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