

A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Ekim-2023

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
B-)Kurucunun Ünvanı	:	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	104.863.775,86
E-) Katılma Payı Sayısı	:	69.988.955,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	29 Kasım 2022
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,498290
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,435265
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	4,39
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	43,49
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	65,91
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	:	0,00
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	49,27
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	12,67
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	-27,85
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)	:	8.688.508,02
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	6.811.621,98

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																			
AKBNK	TL	AKBANK T.A.S.			TRAAKBNK91N6			340.000,00	30,590818	30/10/23			80_100_5		29,460000	10.016.400,00	16,93	6,37	9,55
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			TRADOHOL91Q8			68.300,00	3,690243	31/10/23			80_100_5		13,680000	934.344,00	1,58	0,59	0,89
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			TRADOHOL91Q8			461.600,00	14,048801	31/10/23			80_100_5		13,680000	6.314.688,00	10,66	4,02	6,02
EREGL	TL	EREGL			TRAEREGL91G3			150.000,00	44,771329	31/10/23			80_100_5		37,860000	5.679.000,00	9,59	3,61	5,42
EREGL	TL	EREGL			TRAEREGL91G3			120.000,00	38,208845	31/10/23			80_100_5		37,860000	4.543.200,00	7,67	2,89	4,33
GUBRF	TL	GUBRE FABRİKALARI T.A.S.			TRAGUBRF91E2			3.000,00	-7,581,280647	31/10/23			80_100_5		328,100000	984.300,00	1,66	0,63	0,94
GUBRF	TL	GUBRE FABRİKALARI T.A.S.			TRAGUBRF91E2			-2.000,00	-7,581,280645	31/10/23			80_100_5		328,100000	-656.200,00	-1,11	-0,42	-0,63
HALKB	TL	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			79.300,00	13,520340	30/10/23			80_100_5		13,160000	1.043.588,00	1,76	0,66	1,00
ISCTR	TL	TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.			TRAICTR91N2			370.000,00	21,940931	30/10/23			80_100_5		20,980000	7.762.600,00	13,11	4,94	7,40
ISGYO	TL	İS GAYRİMEN KUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.S.			TRAIISGYO91Q3			92.000,00	22,173283	31/10/23			80_100_5		21,640000	1.990.880,00	3,36	1,27	1,90

A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Ekim-2023

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)
KARSN	TL	KARSAN OTOMOTİV SANAYİİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKARSN1H7			44.000,00	0,000000	31/10/23			80_100_5		9,530000	419.320,00	0,71	0,27	0,40
KOZAA	TL	KOZAD			TREKOZA00014			60.000,00	55,207024	31/10/23			80_100_5		52,600000	3.156.000,00	5,33	2,01	3,01
ODAS	TL				TRODAS00015			344.800,00	13,212886	31/10/23			80_100_5		11,810000	4.072.088,00	6,88	2,59	3,88
SKBNK	TL	ŞEKERBAN K.T.A.S.			TRASKBNK91N8			302.100,00	6,611998	31/10/23			80_100_5		6,650000	2.008.965,00	3,39	1,28	1,92
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.			TRESOKM00014			54.000,00	62,530645	31/10/23			80_100_5		59,800000	3.229.200,00	5,45	2,05	3,08
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.S.			TRETKHO00012			35.000,00	42,040875	31/10/23			80_100_5		40,840000	1.429.400,00	2,41	0,91	1,36
TSKB	TL	TÜRKİYE SİNİAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.			TRATSKBW91N0			165.000,00	1,270507	31/10/23			80_100_5		6,700000	1.105.500,00	1,87	0,70	1,05
TSKB	TL	TÜRKİYE SİNİAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.			TRATSKBW91N0			300.000,00	6,962417	30/10/23			80_100_5		6,700000	2.010.000,00	3,39	1,28	1,92
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			TREVKFB00019			60.000,00	16,843700	31/10/23			80_100_5		16,300000	978.000,00	1,65	0,62	0,93
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.			TRAYKBNK91N6			127.500,00	17,601012	31/10/23			80_100_5		17,240000	2.198.100,00	3,71	1,40	2,10
GRUP TOPLAMI								3.174.600,00								59.219.373,00	100,00	37,67	56,47
GRUP TOPLAMI								3.174.600,00								59.219.373,00	100,00	37,67	56,47

MEVDUAT																			
Istanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	TL		01/11/23	0		38,12		87.511.326,00		31/10/23				87.602.711,80	38,116000	87.602.711,80	100,00	55,73	83,54
GRUP TOPLAMI								87.511.326,00								87.602.711,80	100,00	55,73	83,54
GRUP TOPLAMI								87.511.326,00								87.602.711,80	100,00	55,73	83,54

TÜREV																			
Futures																			
Kısa																			
F_AKBNK1123	TL				F_AKBNK1123			3.400,00	31,350000	30/10/23			686394		30,390000	10.332.600,00	0,00	0,00	0,00
F_DOHOL1023	TL				F_DOHOL1023			683,00	14,200000	26/10/23			686394		13,680000	934.344,00	0,00	0,00	0,00
F_DOHOL1123	TL				F_DOHOL1123			4.616,00	14,180000	31/10/23			686394		14,180000	6.545.488,00	0,00	0,00	0,00
F_EREGL1023	TL				F_EREGL1023			1.500,00	38,380000	27/10/23			686394		37,860000	5.679.000,00	0,00	0,00	0,00
F_EREGL1123	TL				F_EREGL1123			1.200,00	39,040000	31/10/23			686394		39,040000	4.684.800,00	0,00	0,00	0,00
F_GUBRF1023	TL				F_GUBRF1023			10,00	346,690000	31/10/23			686394		328,100000	328.100,00	0,00	0,00	0,00
F_HALKB1123	TL				F_HALKB1123			793,00	13,950000	30/10/23			686394		13,680000	1.084.824,00	0,00	0,00	0,00
F_ISCTR1123	TL				F_ISCTR1123			3.700,00	22,540000	30/10/23			686394		21,630000	8.003.100,00	0,00	0,00	0,00
F_ISGYO1123	TL				F_ISGYO1123			920,00	22,390000	31/10/23			686394		22,390000	2.059.880,00	0,00	0,00	0,00
F_KARSN1023	TL				F_KARSN1023			440,00	9,920000	27/10/23			686394		9,530000	419.320,00	0,00	0,00	0,00
F_KOZAA1123	TL				F_KOZAA1123			600,00	57,490000	31/10/23			686394		54,510000	3.270.600,00	0,00	0,00	0,00
F_ODAS1123	TL				F_ODAS1123			3.448,00	13,570000	31/10/23			686394		12,260000	4.227.248,00	0,00	0,00	0,00
F_SKBNK1123	TL				F_SKBNK1123			3.021,00	6,940000	31/10/23			686394		6,850000	2.069.385,00	0,00	0,00	0,00
F_SOKM1123	TL				F_SOKM1123			540,00	61,730000	31/10/23			686394		61,730000	3.333.420,00	0,00	0,00	0,00
F_TKFEN1123	TL				F_TKFEN1123			350,00	41,980000	31/10/23			686394		41,980000	1.469.300,00	0,00	0,00	0,00
F_TSKB1023	TL				F_TSKB1023			1.650,00	6,950000	25/10/23			686394		6,700000	1.105.500,00	0,00	0,00	0,00
F_TSKB1123	TL				F_TSKB1123			3.000,00	7,210000	30/10/23			686394		6,920000	2.076.000,00	0,00	0,00	0,00
F_VAKBN1123	TL				F_VAKBN1123			600,00	16,890000	31/10/23			686394		16,890000	1.013.400,00	0,00	0,00	0,00
F_YKBNK1123	TL				F_YKBNK1123			1.275,00	17,780000	31/10/23			686394		17,780000	2.266.950,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								31.746,00								60.903.259,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								31.746,00								60.903.259,00	0,00	0,00	0,00

VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								10.381.452,32								10.381.452,32	100,00	6,60	
GRUP TOPLAMI								10.381.452,32								10.381.452,32	100,00	6,60	
GRUP TOPLAMI								10.381.452,32								10.381.452,32	100,00	6,60	

FON PORTFÖY DEĞERİ																157.203.537,12		100,00	
--------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-----------------------	--	---------------	--

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	157.203.537,12	149,91 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0,63	0,00 %
C-)ALACAKLAR	658.200,06	0,63 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-52.997.961,95	-50,54 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	104.863.775,86	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Portföyünün Yönetimi İle İlgili Ödenecek Fon İşletim Giderleri	125.892,53	0,1201 %
Kayda Alma Ücreti	1.706,92	0,0016 %

A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
Ekim-2023

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	534,91	0,0005 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	65.119,38	0,0621 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	775,30	0,0007 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.643,70	0,0016 %
Diğer Harcamalar	4.299,58	0,0041 %
Portföy Saklama Komisyonu	9.602,43	0,0092 %
	209.574,75	0,1999 %

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMMETÜ 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