

**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Şubat-2024**

**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	:	79.390.598,66
E-) Katılma Payı Sayısı	:	44.807.678,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	29 Kasım 2022
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,771808
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,712134
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,49
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6,85
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	59,57
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	45,65
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	15,78
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	0,94
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	2,49
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	8,32
o-)Yatırım Fonu	:	16,78
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	10,04
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,12
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	:	17,11
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	5.003.012,60
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	60.251.306,37

**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)	
<b>HİSSE SENETLERİ</b>																				
<b>Hisse Türk</b>																				
EREGL	TL	EREGL			TRAEREGL91G3			275.000,00	46,849304	21/02/24			80_100_5		45,520000	12.518.000,00	115,69	27,26	15,77	
EREGL	TL	EREGL			TRAEREGL91G3			-225.000,00	46,849304	29/02/24			80_100_5		45,520000	-10.242.000,00	-94,65	-22,30	-12,90	
HALKB	TL	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			100.000,00	13,705714	21/02/24			80_100_5		14,480000	1.448.000,00	13,38	3,15	1,82	
ISCTR	TL	TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.			TRAIISCTR91N2			1.399.986,06	9,001094	29/02/24			80_100_5		11,100000	15.539.845,27	143,61	33,84	19,57	
ISCTR	TL	TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.			TRAIISCTR91N2			-1.399.986,00	9,000000	29/02/24			80_100_5		11,100000	-15.539.844,60	-143,61	-33,84	-19,57	
KOZAA	TL	KOZAD			TREKOZA00014			70.000,00	49,552323	02/02/24			80_100_5		51,050000	3.573.500,00	33,02	7,78	4,50	
TCELL	TL	TURKCELL İLETİSİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			40.000,00	68,500000	21/02/24			80_100_5		66,950000	2.678.000,00	24,75	5,83	3,37	
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			3.000,00	289,750000	07/02/24			78234239		281,750000	845.250,00	7,81	1,84	1,06	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>263.000,06</b>												
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>263.000,06</b>												
<b>BORÇLANMA SENETLERİ</b>																				
<b>Özel Sektör</b>																				
TRFINFM32439	TL	INFO YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	22/03/24	21	TRFINFM32439	48,50		8.600.000,00	89,212000	22/12/23	57,090046				97,434943	8.379.405,08	66,86	18,25	10,55	

## A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Şubat-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)								
TRFAKYM52423	TL	AK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	17/05/24	77	TRFAKYM52423	13,59	1	4.000.000,00	100,000000	29/01/24	53,208810				103,811162	4.152.446,47	33,14	9,04	5,23								
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>12.600.000,00</b>									<b>12.531.851,55</b>	<b>100,00</b>	<b>27,29</b>	<b>15,78</b>							
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>12.600.000,00</b>									<b>12.531.851,55</b>	<b>100,00</b>	<b>27,29</b>	<b>15,78</b>							
<b>T.REPO</b>																											
GUBRF	TL	GUBRE FABRİKALARI T.A.S.	01/03/24	0	TRAGUBRF91E2	48,00		16.021.041,10	48,000000	29/02/24		81.384,00	78301748	16.021.041,10	48,000000	16.021.041,10	100,00	34,89	20,18								
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>16.021.041,10</b>									<b>16.021.041,10</b>	<b>100,00</b>	<b>34,89</b>	<b>20,18</b>							
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>16.021.041,10</b>									<b>16.021.041,10</b>	<b>100,00</b>	<b>34,89</b>	<b>20,18</b>							
<b>MEVDUAT</b>																											
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	TL		01/03/24	0		42,29		412.122,00		29/02/24				412.598,14	42,285000	412.598,14	100,00	0,90	0,52								
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>412.122,00</b>									<b>412.598,14</b>	<b>100,00</b>	<b>0,90</b>	<b>0,52</b>							
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>412.122,00</b>									<b>412.598,14</b>	<b>100,00</b>	<b>0,90</b>	<b>0,52</b>							
<b>TÜREV</b>																											
<b>Futures</b>																											
<b>Kısa</b>																											
F_EREGL0324	TL				F_EREGL0324			500,00	47,500000	29/02/24			686394		47,500000	2.375.000,00	0,00	0,00	0,00								
F_HALKB0324	TL				F_HALKB0324			1.000,00	15,050000	29/02/24			686394		15,050000	1.505.000,00	0,00	0,00	0,00								
F_KOZAA0324	TL				F_KOZAA0324			700,00	53,470000	29/02/24			686394		53,470000	3.742.900,00	0,00	0,00	0,00								
F_TCELL0324	TL				F_TCELL0324			400,00	69,430000	29/02/24			686394		69,430000	2.777.200,00	0,00	0,00	0,00								
F_THYAO0324	TL				F_THYAO0324			30,00	291,660000	29/02/24			686394		291,660000	874.980,00	0,00	0,00	0,00								
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>2.630,00</b>									<b>11.275.080,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>							
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>2.630,00</b>									<b>11.275.080,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>							
<b>VIOP Nakit Teminatı</b>																											
VIOP Nakit Teminatı								6.136.505,62									6.136.505,62	100,00	13,36								
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>6.136.505,62</b>										<b>6.136.505,62</b>	<b>100,00</b>	<b>13,36</b>							
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>6.136.505,62</b>										<b>6.136.505,62</b>	<b>100,00</b>	<b>13,36</b>							
FON PORTFÖY DEĞERİ																<b>45.922.747,08</b>										<b>100,00</b>	

## IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	45.922.747,08	57,84 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0,75	0,00 %
C-)ALACAKLAR	33.938.891,56	42,75 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-471.040,73	-0,59 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	79.390.598,66	100,00 %

## V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Portföyünün Yönetimi İle İlgili Ödenecek Fon İşletim Giderleri	130.834,76	0,1648 %
Kayda Alma Ücreti	1.811,81	0,0023 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	1.367,83	0,0017 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	32.111,23	0,0404 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	308,30	0,0004 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.958,81	0,0025 %
Diğer Harcamalar	7.598,33	0,0096 %
Portföy Saklama Komisyonu	50.093,94	0,0631 %
	226.085,01	0,2848 %

## 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
ISCTR	Bedelsiz Sermaye Artırımı	29/02/24	839.986,06	7.560.793,40

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

A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON  
Şubat-2024

VII-PORTFÖYDEN SATIŞLAR

A) H SSE SENETLER (SATIŞLAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
HİSSE TÜRK							
EREGL	EREGL			01/02/24	43,140	86.280,00	2.000,00
ODAS				01/02/24	9,270	780.534,00	84.200,00
SKBNK	EKERBANK T.A.S.			01/02/24	4,860	243.000,00	50.000,00
TSKB	TÜRK YE SİNA KALKINMA BANKASI A.Ş.			01/02/24	8,200	384.580,00	46.900,00
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.			01/02/24	21,840	436.800,00	20.000,00
EKGYO				19/02/24	10,780	808.500,00	75.000,00
HALKB	TÜRK YE HALK BANKASI A.Ş.			19/02/24	14,550	1.091.250,00	75.000,00
EKGYO				20/02/24	10,560	4.224.000,00	400.000,00
EKGYO				20/02/24	10,550	15.212.045,00	1.441.900,00
EKGYO				20/02/24	10,540	4.224.432,00	400.800,00
ODAS				20/02/24	9,750	3.900.000,00	400.000,00
ODAS				20/02/24	9,740	3.896.000,00	400.000,00
ODAS				20/02/24	9,730	224.081,90	23.030,00
ODAS				20/02/24	9,720	3.664.148,40	376.970,00
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.			20/02/24	24,060	3.609.000,00	150.000,00
VAKBN	TÜRK YE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			20/02/24	14,490	1.449.000,00	100.000,00
AKBNK	AKBANK T.A.S.			29/02/24	41,180	8.236.000,00	200.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A.Ş.			29/02/24	10,970	8.825.386,94	804.502,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A.Ş.			29/02/24	10,980	3.842.956,08	349.996,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A.Ş.			29/02/24	10,960	2.690.548,48	245.488,00
EREGL	EREGL			29/02/24	45,960	3.447.000,00	75.000,00
EREGL	EREGL			29/02/24	45,980	6.897.000,00	150.000,00
HİSSE TÜRK					Toplamı:	78172542,80	5870786,00

B) HAZNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (SATIŞLAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
BONO TÜRK							
TRFA1CP42413	A1 CAPITAL YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.		05/04/24	02/02/24	93,209	14.913.469,95	16.000.000,00
TRFA1CP32414	A1 CAPITAL YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.		29/03/24	19/02/24	95,225	7.618.000,08	8.000.000,00
BONO TÜRK					Toplamı:	22531470,03	24000000,00

C) YATIRIM FONU (SATIŞLAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
Y.FONU TÜRK							
ALLBATROSS PORTFÖY BİRİNCİ PARA PİYASASI (TL) FONU	ALLBATROSS PORTFÖY YÖNETİM KURUMU		08/02/24	08/02/24	1,517	13.267.696,60	8.746.517,00
ROTA PORTFÖY PARA PİYASASI (TL) FONU	ROTA PORTFÖY YÖNETİM A.Ş.		14/02/24	14/02/24	1,651	10.500.539,01	6.361.642,00
ALLBATROSS PORTFÖY BİRİNCİ PARA PİYASASI (TL) FONU	ALLBATROSS PORTFÖY YÖNETİM KURUMU		14/02/24	14/02/24	1,528	7.639.960,00	5.000.000,00

**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Şubat-2024**

A1 PORTFÖY PARA P YASASI (TL) FON	A1 PORTFÖY YÖNET M A . .	16/02/24	16/02/24	1,313	6.562.840,00	5.000.000,00
A1 PORTFÖY PARA P YASASI (TL) FON	A1 PORTFÖY YÖNET M A . .	16/02/24	16/02/24	1,313	1.389.476,61	1.058.594,00
A1 PORTFÖY PARA P YASASI (TL) FON	A1 PORTFÖY YÖNET M A . .	19/02/24	19/02/24	1,317	13.172.350,00	10.000.000,00
Y.FONU TÜRK				Toplamı:	52532862,22	36166753,00

**IX-PORTFÖYE ALIŞLAR**

**A) H SSE SENETLER (ALİ LAR)**

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İ LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
<b>HISSE TÜRK</b>							
ODAS				05/02/24	9,550	3.820.000,00	400.000,00
ODAS				05/02/24	9,560	1.434.000,00	150.000,00
ODAS				05/02/24	9,570	1.435.500,00	150.000,00
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.			05/02/24	22,660	3.399.000,00	150.000,00
THYAO	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			05/02/24	289,750	869.250,00	3.000,00
EKGYO				06/02/24	10,340	1.551.000,00	150.000,00
EKGYO				06/02/24	10,350	2.587.500,00	250.000,00
EKGYO				06/02/24	10,360	207.200,00	20.000,00
EKGYO				06/02/24	10,330	723.100,00	70.000,00
EKGYO				07/02/24	10,330	1.661.601,16	160.852,00
EKGYO				07/02/24	10,320	1.436.007,36	139.148,00
EKGYO				07/02/24	10,310	2.605.337,00	252.700,00
EKGYO				14/02/24	10,750	1.075.000,00	100.000,00
EREGL	EREGL			14/02/24	45,960	2.298.000,00	50.000,00
EREGL	EREGL			14/02/24	45,980	2.299.000,00	50.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .			14/02/24	26,700	801.000,00	30.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .			14/02/24	26,760	1.605.600,00	60.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .			14/02/24	26,780	803.400,00	30.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .			14/02/24	26,840	1.342.000,00	50.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .			14/02/24	26,860	1.074.400,00	40.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .			14/02/24	27,000	1.350.000,00	50.000,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .			14/02/24	26,900	2.690.000,00	100.000,00
EREGL	EREGL			19/02/24	48,920	1.223.000,00	25.000,00
EREGL	EREGL			19/02/24	48,840	1.221.000,00	25.000,00
EREGL	EREGL			19/02/24	49,000	1.225.000,00	25.000,00
EKGYO				19/02/24	10,780	2.964.500,00	275.000,00
EKGYO				19/02/24	10,760	1.076.000,00	100.000,00
TCELL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.S.			19/02/24	68,500	2.740.000,00	40.000,00
EREGL	EREGL			19/02/24	48,980	2.124.556,48	43.376,00
EREGL	EREGL			19/02/24	49,020	324.708,48	6.624,00
HALKB	TÜRK YE HALK BANKASI A. .			19/02/24	14,580	1.093.500,00	75.000,00
AKBNK	AKBANK T.A.S.			26/02/24	41,860	2.093.000,00	50.000,00
HISSE TÜRK				Toplamı:		53153160,48	3120700,00

**G) TERS REPO**

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İ LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
<b>T.REPO</b>							
ASTOR	ASTOR ENERJ A. .		02/02/24	01/02/24		1.000.000,00	8.411,00

**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Şubat-2024**

ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .	02/02/24	01/02/24	5.000.000,00	193.499,00
SASA	SASA POLYESTER SANAYI A.S.	02/02/24	01/02/24	4.000.000,00	103.040,00
OYAKC		02/02/24	01/02/24	1.000.000,00	15.553,00
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	02/02/24	01/02/24	2.000.000,00	90.662,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	06/02/24	05/02/24	15.000.000,00	52.311,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	07/02/24	06/02/24	14.000.000,00	48.952,00
EKGYO		09/02/24	08/02/24	7.500.000,00	723.939,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	12/02/24	09/02/24	1.500.000,00	5.222,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	13/02/24	12/02/24	1.000.000,00	3.419,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYI VE TICARET A.S.	16/02/24	15/02/24	14.000.000,00	166.469,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYI VE TICARET A.S.	19/02/24	16/02/24	2.250.000,00	27.523,00
GUBRF	GUBRE FABRIKALARI T.A.S.	21/02/24	20/02/24	18.000.000,00	86.125,00
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYI VE TICARET A.S.	22/02/24	21/02/24	11.000.000,00	186.283,00
SISE	TÜRK YE E VE CAM FABR KALARI A. .	22/02/24	21/02/24	4.000.000,00	75.543,00
GUBRF	GUBRE FABRIKALARI T.A.S.	23/02/24	22/02/24	15.000.000,00	75.758,00
ISCTR	TÜRK YE BANKASI A. .	26/02/24	23/02/24	15.000.000,00	523.013,00
KONTR		27/02/24	26/02/24	2.000.000,00	6.590,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYI VE TICARET A.S.	27/02/24	26/02/24	2.000.000,00	22.039,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYI VE TICARET A.S.	27/02/24	26/02/24	10.000.000,00	110.254,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	28/02/24	27/02/24	16.500.000,00	57.592,00
EKGYO		29/02/24	28/02/24	4.200.000,00	366.493,00
EUPWR	EUROPOWER ENERJ VE OTOMASYON TEKNOLOJ LER SANAY T CARET A. .	29/02/24	28/02/24	600.000,00	3.412,00
PETKM	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.S.	29/02/24	28/02/24	2.400.000,00	98.604,00
KONTR		29/02/24	28/02/24	1.200.000,00	4.372,00
KLSE	Kaleseramik Canakkale Kalebodur Seramik	29/02/24	28/02/24	500.000,00	6.294,00
ULKER	ULKER B SKÜV SANAY A. .	29/02/24	28/02/24	2.400.000,00	22.409,00
GUBRF	GUBRE FABRIKALARI T.A.S.	01/03/24	29/02/24	16.000.000,00	81.384,00
T.REPO			Toplamı:	189050000,00	3165165,00

**H) MEVDUAT**

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İ LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMİNAL DE ERI
MEVDUAT		stanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	02/02/24	01/02/24		240.607,00	
		stanbul Takas ve Saklama Bankası A.	05/02/24	02/02/24		2.407.109,00	

**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Şubat-2024**

istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	06/02/24	05/02/24	293.794,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	07/02/24	06/02/24	1.167.412,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	08/02/24	07/02/24	385.410,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	09/02/24	08/02/24	720.770,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	12/02/24	09/02/24	508.834,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	13/02/24	12/02/24	259.684,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	14/02/24	13/02/24	49.824,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	15/02/24	14/02/24	15.390.641,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	16/02/24	15/02/24	1.205.180,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	19/02/24	16/02/24	794.448,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	20/02/24	19/02/24	18.856.261,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	21/02/24	20/02/24	9.291.216,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	22/02/24	21/02/24	805.013,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	23/02/24	22/02/24	755.681,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	26/02/24	23/02/24	897.330,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	27/02/24	26/02/24	1.749.679,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	28/02/24	27/02/24	632.009,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	29/02/24	28/02/24	3.034.375,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	01/03/24	29/02/24	412.122,00

MEVDUAT Toplamı: 59857399,00

**I) TAKASBANK PARA P YASASI**

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İLEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
TPP			02/02/24	01/02/24		13.000.000,00	
			05/02/24	02/02/24		4.000.000,00	
			05/02/24	02/02/24		10.000.000,00	

TPP Toplamı: 27000000,00

**J) VADEL İLEM VE OPS YON BORSASI (UZUN)**

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İLEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
FUTURES							
F_VAKBN0224			29/02/24	02/02/24	14,720	312.064,00	212,00
F_KOZAL0224			29/02/24	05/02/24	21,480	214.800,00	100,00
F_KOZAL0224			29/02/24	05/02/24	21,490	169.771,00	79,00
F_EKGYO0224			29/02/24	08/02/24	10,580	264.500,00	250,00

**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Şubat-2024**

F_EKGYO0224	29/02/24	08/02/24	10,590	1.348.107,00	1.273,00
F_EKGYO0224	29/02/24	08/02/24	10,600	795.000,00	750,00
F_TSKB0224	29/02/24	12/02/24	9,480	343.176,00	362,00
F_KOZAA0224	29/02/24	15/02/24	50,690	5.069,00	1,00
F_KOZAA0224	29/02/24	15/02/24	50,700	375.180,00	74,00
F_EKGYO0224	29/02/24	20/02/24	10,690	4.284.552,00	4.008,00
F_EKGYO0224	29/02/24	20/02/24	10,700	19.708.330,00	18.419,00
F_ODAS0224	29/02/24	20/02/24	9,870	7.896.000,00	8.000,00
F_ODAS0224	29/02/24	20/02/24	9,880	3.952.000,00	4.000,00
F_VAKBN0224	29/02/24	20/02/24	14,690	1.469.000,00	1.000,00
F_YKBNK0224	29/02/24	20/02/24	24,390	3.658.500,00	1.500,00
F_ISCTR0224	29/02/24	27/02/24	28,860	16.161.600,00	5.600,00
F_HALKB0224	29/02/24	29/02/24	14,430	103.896,00	72,00
F_HALKB0224	29/02/24	29/02/24	14,440	1.340.032,00	928,00
F_AKBNK0224	29/02/24	29/02/24	41,180	4.426.850,00	1.075,00
F_AKBNK0224	29/02/24	29/02/24	41,200	3.716.240,00	902,00
F_AKBNK0224	29/02/24	29/02/24	41,210	94.783,00	23,00
F_EREGL0224	29/02/24	29/02/24	45,960	137.880,00	30,00
F_EREGL0224	29/02/24	29/02/24	45,970	482.685,00	105,00
F_EREGL0224	29/02/24	29/02/24	45,980	3.163.424,00	688,00
F_EREGL0224	29/02/24	29/02/24	45,990	1.526.868,00	332,00
F_EREGL0224	29/02/24	29/02/24	46,000	7.337.000,00	1.595,00
F_ISCTR0224N1	29/02/24	29/02/24	10,970	4.889.877,50	1.783,00
F_ISCTR0224N1	29/02/24	29/02/24	10,980	6.667.605,00	2.429,00
F_ISCTR0224N1	29/02/24	29/02/24	10,990	3.813.530,00	1.388,00
F_KOZAA0224	29/02/24	29/02/24	49,290	24.645,00	5,00
F_KOZAA0224	29/02/24	29/02/24	49,300	251.430,00	51,00
F_KOZAA0224	29/02/24	29/02/24	49,310	1.449.714,00	294,00
F_KOZAA0224	29/02/24	29/02/24	49,330	54.263,00	11,00
F_KOZAA0224	29/02/24	29/02/24	49,340	1.194.028,00	242,00
F_KOZAA0224	29/02/24	29/02/24	49,350	478.695,00	97,00
F_TCELL0224	29/02/24	29/02/24	65,650	32.825,00	5,00
F_TCELL0224	29/02/24	29/02/24	65,660	32.830,00	5,00
F_TCELL0224	29/02/24	29/02/24	65,670	334.917,00	51,00
F_TCELL0224	29/02/24	29/02/24	65,680	433.488,00	66,00
F_TCELL0224	29/02/24	29/02/24	65,690	105.104,00	16,00
F_TCELL0224	29/02/24	29/02/24	65,700	1.688.490,00	257,00
F_THYAO0224	29/02/24	29/02/24	281,390	84.417,00	3,00
F_THYAO0224	29/02/24	29/02/24	281,420	28.142,00	1,00
F_THYAO0224	29/02/24	29/02/24	281,430	28.143,00	1,00
F_THYAO0224	29/02/24	29/02/24	281,450	28.145,00	1,00
F_THYAO0224	29/02/24	29/02/24	281,460	112.584,00	4,00
F_THYAO0224	29/02/24	29/02/24	281,490	28.149,00	1,00
F_THYAO0224	29/02/24	29/02/24	281,500	534.850,00	19,00
<b>FUTURES</b>			<b>Toplamı:</b>	<b>105583178,50</b>	<b>58108,00</b>

**J) VADEL LEM VE OPS YON BORSASI (KISA)**

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
F_TSKB0224			29/02/24	02/02/24	8,620	312.044,00	362,00
F_KOZAA0224			29/02/24	05/02/24	51,300	292.410,00	57,00
F_KOZAA0224			29/02/24	05/02/24	51,310	35.917,00	7,00
F_KOZAA0224			29/02/24	05/02/24	51,320	56.452,00	11,00
F_ODAS0224			29/02/24	05/02/24	9,840	3.799.224,00	3.861,00
F_ODAS0224			29/02/24	05/02/24	9,850	1.614.415,00	1.639,00
F_ODAS0224			29/02/24	05/02/24	9,860	1.479.000,00	1.500,00

**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Şubat-2024**

F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,560	179.136,00	6,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,570	59.714,00	2,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,580	298.580,00	10,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,590	59.718,00	2,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,720	59.744,00	2,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,730	29.873,00	1,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,770	29.877,00	1,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,780	59.756,00	2,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,790	89.637,00	3,00
F_THYAO0224	29/02/24	05/02/24	298,800	29.880,00	1,00
F_YKBNK0224	29/02/24	05/02/24	23,360	3.504.000,00	1.500,00
F_EKGYO0224	29/02/24	06/02/24	10,640	1.383.200,00	1.300,00
F_EKGYO0224	29/02/24	06/02/24	10,650	3.834.000,00	3.600,00
F_EKGYO0224	29/02/24	07/02/24	10,610	5.092.800,00	4.800,00
F_EKGYO0224	29/02/24	07/02/24	10,620	2.124.000,00	2.000,00
F_EKGYO0224	29/02/24	07/02/24	10,630	1.063.000,00	1.000,00
F_VAKBN0224	29/02/24	13/02/24	14,600	309.520,00	212,00
F_EKGYO0224	29/02/24	14/02/24	10,970	1.097.000,00	1.000,00
F_EREGL0224	29/02/24	14/02/24	46,900	2.368.450,00	505,00
F_EREGL0224	29/02/24	14/02/24	46,910	2.298.590,00	490,00
F_EREGL0224	29/02/24	14/02/24	46,920	23.460,00	5,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,250	817.500,00	300,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,310	1.441.968,00	528,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,320	196.704,00	72,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,360	820.800,00	300,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,380	572.242,00	209,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,390	608.058,00	222,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,400	189.060,00	69,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,420	1.096.800,00	400,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,460	2.562.018,00	933,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,470	184.049,00	67,00
F_ISCTR0224	29/02/24	14/02/24	27,560	1.378.000,00	500,00
F_KOZAL0224	29/02/24	15/02/24	23,060	329.758,00	143,00
F_KOZAL0224	29/02/24	15/02/24	23,070	83.052,00	36,00
F_EKGYO0224	29/02/24	19/02/24	10,920	1.092.000,00	1.000,00
F_EKGYO0224	29/02/24	19/02/24	10,940	2.188.000,00	2.000,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,500	311.850,00	63,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,520	495.200,00	100,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,550	431.085,00	87,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,620	1.161.108,00	234,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,630	79.408,00	16,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,700	1.242.500,00	250,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,710	2.341.341,00	471,00
F_EREGL0224	29/02/24	19/02/24	49,720	144.188,00	29,00
F_TCELL0224	29/02/24	19/02/24	69,500	2.369.950,00	341,00
F_TCELL0224	29/02/24	19/02/24	69,510	410.109,00	59,00
F_AKBNK0224	29/02/24	26/02/24	42,090	2.011.902,00	478,00
F_AKBNK0224	29/02/24	26/02/24	42,100	92.620,00	22,00
F_ISCTR0224N1	29/02/24	27/02/24	11,540	16.156.000,00	5.600,00
F_HALKB0324	29/03/24	29/02/24	14,960	1.416.712,00	947,00
F_HALKB0324	29/03/24	29/02/24	14,970	79.341,00	53,00
F_EREGL0324	29/03/24	29/02/24	47,700	1.044.630,00	219,00
F_EREGL0324	29/03/24	29/02/24	47,710	233.779,00	49,00
F_EREGL0324	29/03/24	29/02/24	47,720	586.956,00	123,00
F_EREGL0324	29/03/24	29/02/24	47,730	310.245,00	65,00
F_EREGL0324	29/03/24	29/02/24	47,740	162.316,00	34,00
F_EREGL0324	29/03/24	29/02/24	47,750	47.750,00	10,00



**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Şubat-2024**

F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,000	1.115.200,00	164,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,010	95.214,00	14,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,020	20.406,00	3,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,030	20.409,00	3,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,040	102.060,00	15,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,050	13.610,00	2,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,060	81.672,00	12,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,070	102.105,00	15,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,080	108.928,00	16,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,090	102.135,00	15,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,100	503.940,00	74,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,110	54.488,00	8,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,120	13.624,00	2,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,130	27.252,00	4,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,140	20.442,00	3,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,160	6.816,00	1,00
F_TCELL0324	29/03/24	29/02/24	68,170	334.033,00	49,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,000	3.121.200,00	612,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,020	15.306,00	3,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,030	51.030,00	10,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,040	10.208,00	2,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,050	91.890,00	18,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,060	5.106,00	1,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,070	56.177,00	11,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,080	10.216,00	2,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,090	148.161,00	29,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,100	5.110,00	1,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,110	25.555,00	5,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,130	25.565,00	5,00
F_KOZAA0324	29/03/24	29/02/24	51,140	5.114,00	1,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,810	87.543,00	3,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,820	87.546,00	3,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,830	58.366,00	2,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,870	291.870,00	10,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,880	116.752,00	4,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,890	58.378,00	2,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,900	29.190,00	1,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,910	58.382,00	2,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,920	29.192,00	1,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,930	29.193,00	1,00
F_THYAO0324	29/03/24	29/02/24	291,940	29.194,00	1,00
Toplamı:				83440974,00	41038,00
				<b>671321587,03</b>	<b>72422550,00</b>