

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F

Şubat-2024

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
B-)Kurucunun Ünvanı	:	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	12.139.772,27
E-) Katılma Payı Sayısı	:	11.802.919,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	28 Temmuz 2023
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,028540
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	0,998598
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,00
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	6,51
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	22,44
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	47,69
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	3,22
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	1,72
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	4,22
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	20,71
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,22
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	:	55,22
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	49.882,81
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	0,00

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																								
DOHOL	TL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.S.			TRADOHOL91Q8			270.000,00	13,573333	29/02/24			80_100_5		13,550000	3.658.500,00	51,73	29,11	30,14					
EREGL	TL	EREGL			TRAEREGL91G3			75.000,00	48,907283	21/02/24			80_100_5		45,520000	3.414.000,00	48,27	27,17	28,12					
GRUP TOPLAMI								345.000,00													7.072.500,00	100,00	56,28	58,26
GRUP TOPLAMI								345.000,00													7.072.500,00	100,00	56,28	58,26
BORÇLANMA SENETLERİ																								
Özel Sektör																								
TRFAKYM52423	TL	AK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	17/05/24	77	TRFAKYM52423	13,59	1	3.000.000,00	100,000000	29/01/24	53,208810				103,811162	3.114.334,85	100,00	24,78	25,65					
GRUP TOPLAMI								3.000.000,00													3.114.334,85	100,00	24,78	25,65
GRUP TOPLAMI								3.000.000,00													3.114.334,85	100,00	24,78	25,65
T.REPO																								
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.	01/03/24	0	TRAASELS91H2	48,00		1.201.578,08	48,000000	29/02/24		20,169,00	78301748	1.201.578,08	48,000000	1.201.578,08	100,00	9,56	9,90					
GRUP TOPLAMI								1.201.578,08													1.201.578,08	100,00	9,56	9,90
GRUP TOPLAMI								1.201.578,08													1.201.578,08	100,00	9,56	9,90

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
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)
MEVDUAT																			
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	TL		01/03/24	0		42,29		27.111,00		29/02/24				27.142,32	42,285000	27.142,32	100,00	0,22	0,22
GRUP TOPLAMI								27.111,00								27.142,32	100,00	0,22	0,22
GRUP TOPLAMI								27.111,00								27.142,32	100,00	0,22	0,22
TÜREV																			
Futures																			
Kısa																			
F_DOHOL0324	TL				F_DOHOL0324			2.700,00	14,080000	29/02/24			686394		14,080000	3.801.600,00	0,00	0,00	0,00
F_EREGL0324	TL				F_EREGL0324			750,00	47,500000	29/02/24			686394		47,500000	3.562.500,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								3.450,00								7.364.100,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								3.450,00								7.364.100,00	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								1.150.600,79								1.150.600,79	100,00	9,16	
GRUP TOPLAMI								1.150.600,79								1.150.600,79	100,00	9,16	
GRUP TOPLAMI								1.150.600,79								1.150.600,79	100,00	9,16	
FON PORTFÖY DEĞERİ																12.566.156,04		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	12.566.156,04	103,51 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0,07	0,00 %
C-)ALACAKLAR	3.300.800,00	27,19 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-3.727.183,84	-30,70 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	12.139.772,27	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	4.519,04	0,0372 %
Fon Portföyünün Yönetimi İle İlgili Ödenecek Fon İşletim Giderleri	14.224,53	0,1172 %
Kayda Alma Ücreti	193,48	0,0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	239,52	0,0020 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	308,30	0,0025 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.958,81	0,0161 %
Diğer Harcamalar	4.336,84	0,0357 %
Portföy Saklama Komisyonu	46.195,79	0,3805 %
	71.976,31	0,5928 %

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

VII-PORTFÖYDEN SATIŞLAR

A) H SSE SENETLER (SATI LAR)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İ LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMİNAL DE ERI
HISSE TÜRK							
AKBNK	AKBANK T.A.S.			29/02/24	41,260	3.300.800,00	80.000,00
HISSE TÜRK				Toplamı:		3300800,00	80000,00

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
Şubat-2024

B) HAZ NE BONOSU VE DEVLET TAHV LLER (SATI LAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
BONO TÜRK							
TRFA1CP32414	A1 CAPITAL YATIRIM MENKUL DE ERLER A. .		29/03/24	19/02/24	95,225	4.846.952,55	5.090.000,00
BONO TÜRK					Toplamı:	4846952,55	5090000,00

IX-PORTFÖYE ALIŞLAR

A) H SSE SENETLER (ALI LAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
HISSE TÜRK							
AKBNK	AKBANK T.A.S.			19/02/24	42,760	1.710.400,00	40.000,00
AKBNK	AKBANK T.A.S.			19/02/24	42,900	1.716.000,00	40.000,00
EREGL	EREGL			19/02/24	48,880	1.222.000,00	25.000,00
EREGL	EREGL			19/02/24	48,860	1.221.500,00	25.000,00
EREGL	EREGL			19/02/24	48,980	1.111.307,22	22.689,00
EREGL	EREGL			19/02/24	49,000	113.239,00	2.311,00
DOHOL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			29/02/24	13,570	2.442.600,00	180.000,00
DOHOL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			29/02/24	13,580	1.222.200,00	90.000,00
HISSE TÜRK					Toplamı:	10759246,22	425000,00

G) TERS REPO

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
T.REPO							
AKBNK	AKBANK T.A.S.		02/02/24	01/02/24		4.000.000,00	99.751,00
SASA	SASA POLYESTER SANAYI A.S.		06/02/24	05/02/24		4.000.000,00	105.486,00
SASA	SASA POLYESTER SANAYI A.S.		07/02/24	06/02/24		4.000.000,00	101.989,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.		09/02/24	08/02/24		4.000.000,00	13.806,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.		12/02/24	09/02/24		4.000.000,00	13.926,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.		13/02/24	12/02/24		4.000.000,00	13.676,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.		14/02/24	13/02/24		4.000.000,00	13.817,00
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.		15/02/24	14/02/24		4.000.000,00	14.122,00
PGSUS			16/02/24	15/02/24		4.000.000,00	4.737,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONIK SANAYI VE TICARET A.S.		19/02/24	16/02/24		4.000.000,00	48.662,00
GUBRF	GUBRE FABRIKALARI T.A.S.		20/02/24	19/02/24		2.500.000,00	12.231,00
GUBRF	GUBRE FABRIKALARI T.A.S.		21/02/24	20/02/24		7.500.000,00	35.903,00
KRDMD	KARDEMİR KARABUK DEMİR CELİK SAN. VE TIC. A.S.(D GRUBU)		22/02/24	21/02/24		500.000,00	16.836,00
ASELS	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI VE TICARET A.S.		23/02/24	22/02/24		500.000,00	8.217,00
KRDMD	KARDEMİR KARABUK DEMİR CELİK SAN. VE TIC.		26/02/24	23/02/24		500.000,00	17.266,00

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
Şubat-2024

	A.S.(D GRUBU)					
MGROS	MIGROS T CARET A. .	27/02/24	26/02/24		950.000,00	1.991,00
MGROS	MIGROS T CARET A. .	28/02/24	27/02/24		950.000,00	2.016,00
EREGL	EREGL	29/02/24	28/02/24		1.000.000,00	21.377,00
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.	01/03/24	29/02/24		1.200.000,00	20.169,00
T.REPO				Toplamı:	55600000,00	565978,00

H) MEVDUAT

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İLEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
MEVDUAT		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	02/02/24	01/02/24		22.533,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	05/02/24	02/02/24		27.459,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	06/02/24	05/02/24		42.794,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	07/02/24	06/02/24		47.852,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	08/02/24	07/02/24		52.915,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	09/02/24	08/02/24		31.154,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	12/02/24	09/02/24		36.418,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	13/02/24	12/02/24		52.229,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	14/02/24	13/02/24		43.277,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	15/02/24	14/02/24		48.555,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	16/02/24	15/02/24		53.291,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	19/02/24	16/02/24		58.834,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	20/02/24	19/02/24		5.121.626,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	21/02/24	20/02/24		158.163,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	22/02/24	21/02/24		83.020,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	23/02/24	22/02/24		83.769,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	26/02/24	23/02/24		84.519,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	27/02/24	26/02/24		44.869,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	28/02/24	27/02/24		46.363,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	29/02/24	28/02/24		125.658,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	01/03/24	29/02/24		27.111,00	
MEVDUAT				Toplamı:		6292409,00	

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
Şubat-2024

I) TAKASBANK PARA P YASASI

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHI	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
TPP			05/02/24	02/02/24		4.000.000,00	
			08/02/24	07/02/24		4.000.000,00	
TPP					Toplamı:	8000000,00	

J) VADEL LEM VE OPS YON BORSASI (UZUN)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHI	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
FUTURES							
F_EKGYO0224			29/02/24	19/02/24	10,930	819.750,00	750,00
F_AKBNK0224			29/02/24	29/02/24	41,260	3.300.800,00	800,00
F_EREGL0224			29/02/24	29/02/24	45,880	59.644,00	13,00
F_EREGL0224			29/02/24	29/02/24	45,900	3.382.830,00	737,00
FUTURES					Toplamı:	7563024,00	2300,00

J) VADEL LEM VE OPS YON BORSASI (KISA)

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHI	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
F_EREGL0224			29/02/24	19/02/24	49,560	1.214.220,00	245,00
F_EREGL0224			29/02/24	19/02/24	49,570	24.785,00	5,00
F_EREGL0224			29/02/24	19/02/24	49,580	1.160.172,00	234,00
F_EREGL0224			29/02/24	19/02/24	49,590	79.344,00	16,00
F_EREGL0224			29/02/24	19/02/24	49,700	1.242.500,00	250,00
F_AKBNK0224			29/02/24	19/02/24	43,360	1.604.320,00	370,00
F_AKBNK0224			29/02/24	19/02/24	43,370	130.110,00	30,00
F_AKBNK0224			29/02/24	19/02/24	43,500	1.418.100,00	326,00
F_AKBNK0224			29/02/24	19/02/24	43,510	321.974,00	74,00
F_EKGYO0224			29/02/24	19/02/24	10,940	820.500,00	750,00
F_EREGL0324			29/03/24	29/02/24	47,600	3.122.560,00	656,00
F_EREGL0324			29/03/24	29/02/24	47,610	423.729,00	89,00
F_EREGL0324			29/03/24	29/02/24	47,620	23.810,00	5,00
F_DOHOL0324			29/03/24	29/02/24	14,070	2.303.259,00	1.637,00
F_DOHOL0324			29/03/24	29/02/24	14,090	1.386.456,00	984,00
F_DOHOL0324			29/03/24	29/02/24	14,100	111.390,00	79,00
					Toplamı:	15387229,00	5750,00
						111749660,77	6169028,00