

**A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON**  
**Mart-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	:	43.476.124,67
E-) Katılma Payı Sayısı	:	23.616.895,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	29 Kasım 2022
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,840891
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,771808
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,90
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	11,01
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	65,79
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	22,24
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	22,90
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	27,54
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	2,20
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	5,07
o-)Yatırım Fonu	:	3,47
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	16,58
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,02
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	9,86
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	8,19
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	2.895.331,62
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	40.507.570,14

**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			50.000,00	46,849304	04/03/24			78325360		42,320000	2.116.000,00	21,15	4,84	4,87	
HALKB	TL	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.			TRETHAL00019			100.000,00	13,705714	21/02/24			80_100_5		13,560000	1.356.000,00	13,55	3,10	3,12	
ISCTR	TL	TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.			TRAICTR91N2			0,06	34.059.994,166	04/03/24			80_100_5		11,390000	0,68	0,00	0,00	0,00	
KOZAA	TL	KOZAD			TREKOZA00014			55.000,00	49,552323	13/03/24			80_100_5		49,980000	2.748.900,00	27,48	6,29	6,32	
ODAS	TL				TRODAS00015			20.000,00	8,830000	29/03/24			80_100_5		9,170000	183.400,00	1,83	0,42	0,42	
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			40.000,00	68,500000	21/02/24			80_100_5		67,700000	2.708.000,00	27,06	6,20	6,23	
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.			TRATHYAO91M5			3.000,00	289,750000	07/02/24			78234239		297,750000	893.250,00	8,93	2,05	2,05	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>268.000,06</b>												
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>268.000,06</b>												
<b>BORÇLANMA SENETLERİ</b>																				
<b>Özel Sektör</b>																				
TRFAKYM52423	TL	AK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	17/05/24	46	TRFAKYM52423	13,59	1	4.000.000,00	100,000000	29/01/24	53,208810				107,641683	4.305.667,31	100,00	9,86	9,90	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>4.000.000,00</b>												
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>4.000.000,00</b>												

## A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON

Mart-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)	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>4.000.000,00</b>								<b>4.305.667,31</b>	<b>100,00</b>	<b>9,86</b>	<b>9,90</b>	
<b>MEVDUAT</b>																				
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	TL		01/04/24	0		44,75		784.835,00		29/03/24				787.713,61	44,747000	787.713,61	100,00	1,80	1,81	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>784.835,00</b>								<b>787.713,61</b>	<b>100,00</b>	<b>1,80</b>	<b>1,81</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>784.835,00</b>								<b>787.713,61</b>	<b>100,00</b>	<b>1,80</b>	<b>1,81</b>	
<b>TPP</b>																				
TPP			01/04/24	0		53,40		5.264.002,96	53,400000	29/03/24				5.264.002,96	53,400000	5.264.002,96	27,59	12,05	12,11	
TPP			01/04/24	0		52,70		13.818.597,20	52,700000	29/03/24				13.818.597,20	52,700000	13.818.597,20	72,41	31,64	31,78	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>19.082.600,16</b>								<b>19.082.600,16</b>	<b>100,00</b>	<b>43,69</b>	<b>43,89</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>19.082.600,16</b>								<b>19.082.600,16</b>	<b>100,00</b>	<b>43,69</b>	<b>43,89</b>	
<b>DİĞER</b>																				
<b>Y.Fonu Türk</b>																				
A1 PORTFÖY PARA PİYASASI (TL) FON	TL	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			TRYA1PY00040			5.813.999,00	1,375799	26/03/24					1,381362	8.031.237,29	100,00	18,38	18,47	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>5.813.999,00</b>									<b>8.031.237,29</b>	<b>100,00</b>	<b>18,38</b>	<b>18,47</b>
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>5.813.999,00</b>								<b>8.031.237,29</b>	<b>100,00</b>	<b>18,38</b>	<b>18,47</b>	
<b>TÜREV</b>																				
<b>Futures</b>																				
<b>Kısa</b>																				
F_EREGL0324	TL				F_EREGL0324			500,00	42,150000	29/02/24			686394		42,320000	2.116.000,00	0,00	0,00	0,00	
F_HALKB0324	TL				F_HALKB0324			1.000,00	13,460000	29/02/24			686394		13,560000	1.356.000,00	0,00	0,00	0,00	
F_KOZAA0324	TL				F_KOZAA0324			550,00	47,830000	11/03/24			686394		49,980000	2.748.900,00	0,00	0,00	0,00	
F_ODAS0424	TL				F_ODAS0424			200,00	9,340000	27/03/24			686394		9,560000	191.200,00	0,00	0,00	0,00	
F_TCELL0324	TL				F_TCELL0324			400,00	68,300000	29/02/24			686394		67,700000	2.708.000,00	0,00	0,00	0,00	
F_THYAO0324	TL				F_THYAO0324			30,00	298,990000	29/02/24			686394		297,750000	893.250,00	0,00	0,00	0,00	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>2.680,00</b>								<b>10.013.350,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>2.680,00</b>								<b>10.013.350,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	
<b>VIOP Nakit Teminatı</b>																				
VIOP Nakit Teminatı								1.472.281,00									1.472.281,00	100,00	3,37	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>1.472.281,00</b>									<b>1.472.281,00</b>	<b>100,00</b>	<b>3,37</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>1.472.281,00</b>									<b>1.472.281,00</b>	<b>100,00</b>	<b>3,37</b>	
FON PORTFÖY DEĞERİ																<b>43.685.050,05</b>		<b>100,00</b>		

## IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	43.685.050,05	100,48 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0,17	0,00 %
C-)ALACAKLAR	0,06	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-208.925,61	-0,48 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	43.476.124,67	100,00 %

## V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	7.049,90	0,0162 %
Fon Portföyünün Yönetimi İle İlgili Ödenecek Fon İşletim Giderleri	56.610,71	0,1302 %
Kayda Alma Ücreti	-1.801,33	-0,0041 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	3.548,80	0,0082 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	308,30	0,0007 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	2.335,54	0,0054 %
Diğer Harcamalar	8.785,47	0,0202 %
Portföy Saklama Komisyonu	29.127,24	0,0670 %
	105.964,63	0,2438 %

## VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvanı	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

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

A1 PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON  
Mart-2024

VII-PORTFÖYDEN SATIŞLAR

A) H SSE SENETLER (SATIŞLAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
HİSSE TÜRK							
KOZAA	KOZAD			11/03/24	53,100	265.500,00	5.000,00
KOZAA	KOZAD			11/03/24	53,200	532.000,00	10.000,00
HİSSE TÜRK				Toplamı:		797500,00	15000,00

VIII-İTFALAR

B)HAZ NE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (İTFALAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
BONO TÜRK							
TRFINFM32439	NFO YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.		22/03/24	22/03/24	0,892	8.600.000,00	8.600.000,00
BONO TÜRK				Toplamı:		8600000,00	8600000,00

IX-PORTFÖYE ALIŞLAR

A) H SSE SENETLER (ALİŞLAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
HİSSE TÜRK							
ODAS				27/03/24	8,830	176.600,00	20.000,00
HİSSE TÜRK				Toplamı:		176600,00	20000,00

C) YATIRIM FONU (ALİŞLAR)

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
Y.FONU TÜRK							
A1 PORTFÖY PARA P YASASI (TL) FON	A1 PORTFÖY YÖNETİM A.Ş.		26/03/24	26/03/24	1,376	7.998.894,01	5.813.999,00
Y.FONU TÜRK				Toplamı:		7998894,01	5813999,00

G) TERS REPO

KIYMET	HRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İLEMLER TARİHİ	FIYAT	LEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
T.REPO							
GUBRF	GUBRE FABRİKALARI T.A.Ş.		04/03/24	01/03/24		16.000.000,00	79.248,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		05/03/24	04/03/24		19.000.000,00	241.270,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		06/03/24	05/03/24		19.000.000,00	250.000,00
EREGL	EREGL		07/03/24	06/03/24		1.000.000,00	21.950,00
DOHOL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.		07/03/24	06/03/24		7.000.000,00	537.222,00
EREGL	EREGL		07/03/24	06/03/24		1.500.000,00	32.968,00
KRDMD	KARDEMİR KARABUK DEMİR ÇELİK SAN. VE TİC. A.Ş.(D GRUBU)		07/03/24	06/03/24		1.500.000,00	58.778,00

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

PETKM	PETKIM PETROKİMYA HOLDİNG A.S.	07/03/24	06/03/24	1.500.000,00	65.275,00	
SAHOL	HACI OMER SABANCI HOLDİNG A.S.	07/03/24	06/03/24	7.000.000,00	91.504,00	
ALARK	ALARKO HOLDİNG A.S.	08/03/24	07/03/24	2.000.000,00	15.711,00	
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	08/03/24	07/03/24	18.500.000,00	68.266,00	
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.	11/03/24	08/03/24	12.000.000,00	161.074,00	
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	12/03/24	11/03/24	14.900.000,00	52.697,00	
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	12/03/24	11/03/24	5.600.000,00	19.806,00	
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	13/03/24	12/03/24	3.310.000,00	11.939,00	
GESAN		14/03/24	13/03/24	5.500.000,00	78.404,00	
MGROS	MİGROS T CARET A. .	14/03/24	13/03/24	1.300.000,00	2.628,00	
SİSE	TÜRK YE E VE CAM FABR KALARI A. .	14/03/24	13/03/24	700.000,00	14.731,00	
KRDMD	KARDEMİR KARABUK DEMİR CELİK SAN. VE TİC. A.S.(D GRUBU)	14/03/24	13/03/24	4.900.000,00	201.315,00	
KOZAL	HAZ NE	14/03/24	13/03/24	200.000,00	8.468,00	
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	14/03/24	13/03/24	5.400.000,00	19.637,00	
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	15/03/24	14/03/24	7.000.000,00	25.689,00	
THYAO	TURK HAVA YOLLARI A.O.	15/03/24	14/03/24	3.000.000,00	11.020,00	
T.REPO				Toplamı:	157810000,00	2069600,00

**H) MEVDUAT**

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İLEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERİ	NOMİNAL DE ERİ
MEVDUAT		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	04/03/24	01/03/24		295.546,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	05/03/24	04/03/24		841.555,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	06/03/24	05/03/24		1.012.649,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	07/03/24	06/03/24		664.856,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	08/03/24	07/03/24		165.001,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	11/03/24	08/03/24		821.271,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	12/03/24	11/03/24		34.410,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	13/03/24	12/03/24		6.530.195,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	14/03/24	13/03/24		2.234.310,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	15/03/24	14/03/24		1.005.927,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	18/03/24	15/03/24		860.034,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	19/03/24	18/03/24		392.631,00	
		istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	20/03/24	19/03/24		500.808,00	

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

istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	21/03/24	20/03/24	142.937,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	22/03/24	21/03/24	254.648,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	25/03/24	22/03/24	224.710,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	26/03/24	25/03/24	1.045.518,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	27/03/24	26/03/24	1.826.830,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	28/03/24	27/03/24	564.529,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	29/03/24	28/03/24	385.206,00
istanbul Takas ve Saklama Bankası A. .	01/04/24	29/03/24	784.835,00

MEVDUAT Toplamı: 20588406,00

**I) TAKASBANK PARA P YASASI**

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
TPP			11/03/24	08/03/24		8.000.000,00	
			13/03/24	12/03/24		10.000.000,00	
			15/03/24	14/03/24		9.000.000,00	
			18/03/24	15/03/24		19.000.000,00	
			19/03/24	18/03/24		19.750.000,00	
			20/03/24	19/03/24		19.750.000,00	
			21/03/24	20/03/24		19.750.000,00	
			22/03/24	21/03/24		19.500.000,00	
			25/03/24	22/03/24		28.000.000,00	
			26/03/24	25/03/24		27.000.000,00	
			27/03/24	26/03/24		18.000.000,00	
			28/03/24	27/03/24		20.000.000,00	
			29/03/24	28/03/24		20.000.000,00	
			01/04/24	29/03/24		5.241.000,00	
			01/04/24	29/03/24		13.759.000,00	

TPP Toplamı: 256750000,00

KIYMET	HRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	I LEM TARİHİ	FIYAT	LEM DE ERI	NOMINAL DE ERI
FUTURES							
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,570	87.312,00	16,00
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,580	5.458,00	1,00
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,590	10.918,00	2,00
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,600	180.180,00	33,00
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,610	5.461,00	1,00
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,630	27.315,00	5,00
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,640	60.104,00	11,00
F_KOZAA0324			29/03/24	11/03/24	54,650	442.665,00	81,00
F_ODAS0424			30/04/24	27/03/24	9,280	185.600,00	200,00

FUTURES Toplamı: 1005013,00 350,00

**453726413,01 16518949,00**