

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
Mayıs-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	:	97.888.555,77
E-) Katılma Payı Sayısı	:	86.034.558,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	28 Temmuz 2023
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,137782
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,105278
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,94
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı E- Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	17,82
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	2,52
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	86,02
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	1,54
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	8,05
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	0,00
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	1,87
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri- Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,04
b-)Hazine Bonosu	:	0,12
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	2,58
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	93,04
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)İ-	:	10.309.979,12
J)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	61.339.457,24

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																								
ALKLCHE	TL	ALTINKILIÇ GIDA VE SÜT SANAYİ TİCARET A.Ş.			ALKLCHE			42,00	22,980000	30/05/24			80_112_5		22,980000	965,16	0,03	0,00	0,00					
OZYSR	TL	ÖZYAŞAR TEL VE GALVANİZL EME SANAYİ A.Ş.			OZYSR			51,00	28,000000	28/05/24			80_112_5		37,260000	1.900,26	0,06	0,00	0,00					
QUAGR	TL	QUA GRANİTE HAYAL YAPI VE ÜRÜNLERİ SANAYİ TİCARET A.Ş.			TREQAGR00022			1.000.000,00	4,490000	13/05/24			80_100_5		3,390000	3.390.000,00	99,91	3,14	3,46					
GRUP TOPLAMI								1.000.093,00													3.392.865,42	100,00	3,14	3,46
GRUP TOPLAMI								1.000.093,00													3.392.865,42	100,00	3,14	3,46
BORÇLANMA SENETLERİ																								
Özel Sektör																								
TRFQAGRE2412	TL	QUA GRANİTE HAYAL YAPI VE ÜRÜNLERİ SANAYİ TİCARET A.	09/10/24	128	TRFQAGRE2412	49,78	4	33.000.000,00	108,244900	18/03/24	55,086786		78372779		106,765470	35.232.605,00	44,03	32,59	35,99					

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
Mayıs-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)		
TRFQYHLE2419	TL	Ş. Q Yatırım Holding A.Ş.	10/10/24	129	TRFQYHLE2419	49,92	4	42.000.000,00	108,109200	18/03/24	55,123737		78372779		106,628869	44.784.125,15	55,97	41,42	45,75		
GRUP TOPLAMI								75.000.000,00									80.016.730,15	100,00	74,01	81,74	
GRUP TOPLAMI								75.000.000,00										80.016.730,15	100,00	74,01	81,74
T.REPO																					
TRT140126T11	TL	HAZİNE	03/06/24	0	TRT140126T11	52,85	2	10.043.438,36	52,850000	31/05/24		1.294.830,00	78665771	10.043.438,36	52,850000	10.043.438,36	100,00	9,29	10,26		
GRUP TOPLAMI								10.043.438,36										10.043.438,36	100,00	9,29	10,26
GRUP TOPLAMI								10.043.438,36										10.043.438,36	100,00	9,29	10,26
MEVDUAT																					
TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	TL		03/06/24	0		49,00		14.602.208,70		31/05/24				14.660.856,92	49,000000	14.660.856,92	100,00	13,56	14,98		
GRUP TOPLAMI								14.602.208,70										14.660.856,92	100,00	13,56	14,98
GRUP TOPLAMI								14.602.208,70										14.660.856,92	100,00	13,56	14,98
VIOP Nakit Teminatı																					
VIOP Nakit Teminatı								0,00										0,00	100,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								0,00											0,00	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI								0,00											0,00	100,00	0,00
FON PORTFÖY DEĞERİ																108.113.890,85			100,00		

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	108.113.890,85	110,45 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0,00	0,00 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-10.225.335,08	-10,45 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	97.888.555,77	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Portföyünün Yönetimi İle İlgili Ödenecek Fon İşletim Giderleri	154.134,48	0,1575 %
Kayda Alma Ücreti	2.193,71	0,0022 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	4.732,90	0,0048 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	3.066,29	0,0031 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	1.944,60	0,0020 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	18.904,74	0,0193 %
Diğer Harcamalar	6.048,34	0,0062 %
Portföy Saklama Komisyonu	33.695,46	0,0344 %
	224.720,52	0,2295 %

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