

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F Mart-2024

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBITRAJ SERBEST F
B-)Kurucunun Ünvanı	:	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	195.938.577,71
E-) Katılma Payı Sayısı	:	183.892.068,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	28 Temmuz 2023
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	1,065509
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	1,028540
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,59
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	10,34
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	21,65
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	59,53
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	1,76
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	4,78
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	4,89
o-)Yatırım Fonu	:	4,09
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	3,30
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,06
b-)Hazine Bonosu	:	1,44
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	3,11
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	86,08
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	192.290.000
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	12.340.200

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)
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Özel Sektör																			
TRFBIEN42418	TL	BİEN FİNANS FAKTORİN G A.Ş.	24/04/24	23	TRFBIEN42418	11,22	1	25.000.000,00	106,265000	19/03/24	53,188631		78376792		108,269955	27.067.488,85	19,36	13,80	13,81
TRFBIEN52417	TL	BİEN FİNANS FAKTORİN G A.Ş.	13/05/24	42	TRFBIEN52417	11,71	1	10.000.000,00	103,761100	14/03/24	56,702620		78357111		106,084971	10.608.497,11	7,59	5,41	5,41
TRFAKYM52423	TL	AK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	17/05/24	46	TRFAKYM52423	13,59	1	3.000.000,00	100,000000	29/01/24	53,208810				107,641683	3.229.250,48	2,31	1,65	1,65
TRFQYHL52435	TL	Q Yatırım Holding A.Ş.	29/05/24	58	TRFQYHL52435	15,63	1	15.000.000,00	105,859500	18/03/24	53,328329		78372779		108,035030	16.205.254,52	11,59	8,26	8,27
TRFQAGRE2412	TL	QUA GRANITE HAYAL YAPI VE ÜRÜNLERİ SANAYİ TİCARET A.Ş.	09/10/24	191	TRFQAGRE2412	49,78	4	33.000.000,00	108,244900	18/03/24	55,266100		78372779		110,388875	36.428.328,87	26,05	18,57	18,59
TRFQYHLE2419	TL	Q Yatırım Holding A.Ş.	10/10/24	192	TRFQYHLE2419	49,92	4	42.000.000,00	108,109200	18/03/24	55,266650		78372779		110,255717	46.307.401,10	33,10	23,61	23,63
GRUP TOPLAMI								128.000.000,00											
GRUP TOPLAMI								128.000.000,00											
MEVDUAT																			
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	TL		01/04/24	0		44,75		50.161.019,00		29/03/24				50.344.998,93	44,747000	50.344.998,93	100,00	25,66	25,69
GRUP TOPLAMI								50.161.019,00											
								50.344.998,93											
								100,00											
								25,66											
								25,69											

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F																			
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)
GRUP TOPLAMI								50.161.019,00								50.344.998,93	100,00	25,66	25,69
DİĞER																			
Y.Fonu Türk																			
ALLBATROSS PORTFÖY BİRİNCİ PARA PİYASASI (TL) FONU	TL	ALLBATROSS PORTFÖY YÖNETİM ŞİRKETİ			TRYALBT00028			3.700.000,00	1,605424	27/03/24					1,609459	5.954.998,30	100,00	3,04	3,04
GRUP TOPLAMI								3.700.000,00								5.954.998,30	100,00	3,04	3,04
GRUP TOPLAMI								3.700.000,00								5.954.998,30	100,00	3,04	3,04
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																196.146.218,16		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	196.146.218,16	100,11 %
B-)HAZIR DEĞERLER	0,61	0,00 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-207.641,06	-0,11 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	195.938.577,71	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Fon Portföyünün Yönetimi İle İlgili Ödenecek Fon İşletim Giderleri	137.401,86	0,0701 %
Kayda Alma Ücreti	9.409,75	0,0048 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	229,37	0,0001 %
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	4.697,07	0,0024 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	308,30	0,0002 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	2.335,54	0,0012 %
Diğer Harcamalar	8.377,76	0,0043 %
Portföy Saklama Komisyonu	31.938,63	0,0163 %
	194.698,28	0,0994 %

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) HİSSE SENETLERİ(SATIŞLAR)

KIYMET	İHRAÇCI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
HISSE TÜRK DOHOL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			13/03/24	13,150	920.500,00	70.000,00
DOHOL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDING A.S.			13/03/24	13,110	1.474.992,99	112.509,00

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
Mart-2024

DOHOL	DOGAN SIRKETLER GRUBU HOLDING A.S.	13/03/24	13,120	679.930,88	51.824,00
DOHOL	DOGAN SIRKETLER GRUBU HOLDING A.S.	13/03/24	13,100	467.237,70	35.667,00
EREGL	EREGL	13/03/24	44,980	3.373.500,00	75.000,00
HISSE TÜRK			Toplamı:	6916161,57	345000,00

C) YATIRIM FONU (SATIŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
Y.FONU TÜRK							
A1 PORTFÖY KISA VADELİ KATILIM SERBEST FON	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		29/03/24	29/03/24	1,247	7.946.890,13	6.375.000,00
A1 PORTFÖY PARA PİYASASI (TL) FON	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		29/03/24	29/03/24	1,381	42.169.825,45	30.527.715,00
Y.FONU TÜRK				Toplamı:		50116715,58	36902715,00

VIII-İTFALAR

B)HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (ITFALAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
BONO TÜRK							
TRFBIEN32435	BİEN FİNANS FAKTORİNG A.Ş.		25/03/24	25/03/24	1,104	28.540.000,00	28.540.000,00
BONO TÜRK				Toplamı:		28540000,00	28540000,00

IX-PORTFÖYE ALIŞLAR

B)HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (ALİŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
TRFBIEN32435	BİEN FİNANS FAKTORİNG A.Ş.		25/03/24	14/03/24	110,231	25.353.213,41	23.000.000,00
TRFBIEN42418	BİEN FİNANS FAKTORİNG A.Ş.		24/04/24	14/03/24	106,016	15.902.459,34	15.000.000,00
TRFBIEN52417	BİEN FİNANS FAKTORİNG A.Ş.		13/05/24	14/03/24	103,761	10.376.110,00	10.000.000,00
TRFQYHL52435	Q Yatırım Holding A.Ş.		29/05/24	14/03/24	105,781	13.370.758,36	12.640.000,00
TRFQAGRE2412	QUA GRANITE HAYAL YAPI VE ÜRÜNLERİ SANAYİ TİCARET A.Ş.		09/10/24	15/03/24	108,150	27.037.464,29	25.000.000,00
TRFQYHLE2419	Q Yatırım Holding A.Ş.		10/10/24	15/03/24	108,019	34.965.898,99	32.370.000,00
TRFQYHL52435	Q Yatırım Holding A.Ş.		29/05/24	18/03/24	106,278	2.508.170,85	2.360.000,00
TRFQAGRE2412	QUA GRANITE HAYAL YAPI VE ÜRÜNLERİ SANAYİ TİCARET A.Ş.		09/10/24	18/03/24	108,542	8.683.364,04	8.000.000,00
TRFQYHLE2419	Q Yatırım Holding A.Ş.		10/10/24	18/03/24	108,411	10.439.945,86	9.630.000,00
TRFBIEN42418	BİEN FİNANS FAKTORİNG A.Ş.		24/04/24	19/03/24	106,638	10.663.783,52	10.000.000,00
TRFBIEN32435	BİEN FİNANS FAKTORİNG A.Ş.		25/03/24	19/03/24	110,904	6.144.092,56	5.540.000,00
				Toplamı:		165445261,22	153540000,00

C) YATIRIM FONU (ALİŞLAR)

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
Y.FONU TÜRK							

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F Mart-2024							
A1 PORTFÖY PARA PİYASASI (TL) FON	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	26/03/24	26/03/24	1,376	41.999.999,77	30.527.715,00	
A1 PORTFÖY KISA VADELİ KATILIM SERBEST FON	A1 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	26/03/24	26/03/24	1,242	7.920.076,88	6.375.000,00	
ALLBATROSS PORTFÖY BİRİNCİ PARA PİYASASI (TL) FONU	ALLBATROSS PORTFÖY YÖNETİM ŞİRKETİ	27/03/24	27/03/24	1,605	5.940.068,80	3.700.000,00	
Y.FONU TÜRK				Toplamı:	55860145,45	40602715,00	

G) TERS REPO

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
T.REPO							
GUBRF	GUBRE FABRİKALARI T.A.S.		04/03/24	01/03/24		1.200.000,00	5.953,00
FROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.S.		05/03/24	04/03/24		750.000,00	758,00
MGROS	MIGROS TİCARET A.Ş.		06/03/24	05/03/24		750.000,00	1.587,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.		07/03/24	06/03/24		750.000,00	9.994,00
KOZAA	KOZAD		08/03/24	07/03/24		1.000.000,00	19.362,00
VESTL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.		11/03/24	08/03/24		1.000.000,00	13.414,00
ODAS			12/03/24	11/03/24		1.000.000,00	93.024,00
DOHOL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.S.		13/03/24	12/03/24		1.000.000,00	73.910,00
KOZAL	HAZİNE		14/03/24	13/03/24		500.000,00	21.098,00
T.REPO				Toplamı:		7950000,00	239100,00

H) MEVDUAT

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
MEVDUAT							
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	04/03/24	01/03/24		23.172,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	05/03/24	04/03/24		34.286,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	06/03/24	05/03/24		35.048,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	07/03/24	06/03/24		36.071,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	08/03/24	07/03/24		107.104,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	11/03/24	08/03/24		54.095,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	12/03/24	11/03/24		58.248,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	13/03/24	12/03/24		32.967,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	14/03/24	13/03/24		520.109,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	15/03/24	14/03/24		1.334.114,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	18/03/24	15/03/24		3.748.273,00	
		İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	19/03/24	18/03/24		9.149.581,00	

A1 PORTFÖY İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST F
Mart-2024

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	20/03/24	19/03/24	24.335.899,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	21/03/24	20/03/24	13.095.451,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	22/03/24	21/03/24	13.119.487,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	25/03/24	22/03/24	8.897.777,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	26/03/24	25/03/24	35.877.789,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	27/03/24	26/03/24	6.028.921,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	28/03/24	27/03/24	94.998,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	29/03/24	28/03/24	95.116,00
İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.	01/04/24	29/03/24	50.161.019,00
MEVDUAT			Toplamı: 166839525,00

I) TAKASBANK PARA PİYASASI

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
TPP			18/03/24	15/03/24		5.000.000,00	
			20/03/24	19/03/24		10.000.000,00	
			21/03/24	20/03/24		10.000.000,00	
			22/03/24	21/03/24		10.000.000,00	
			25/03/24	22/03/24		15.000.000,00	
			26/03/24	25/03/24		160.000,00	
			26/03/24	25/03/24		19.840.000,00	
TPP			Toplamı:			70000000,00	

KIYMET	İHRAÇÇI KURUM	BANKA	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMİNAL DEĞERİ
FUTURES			29/03/24	13/03/24	13,430	201.450,00	150,00
F_DOHOL0324			29/03/24	13/03/24	13,440	1.653.120,00	1.230,00
F_DOHOL0324			29/03/24	13/03/24	13,450	1.213.190,00	902,00
F_DOHOL0324			29/03/24	13/03/24	13,460	562.628,00	418,00
F_EREGL0324			29/03/24	13/03/24	46,080	124.416,00	27,00
F_EREGL0324			29/03/24	13/03/24	46,090	377.938,00	82,00
F_EREGL0324			29/03/24	13/03/24	46,100	2.955.010,00	641,00
FUTURES			Toplamı:			7087752,00	3450,00
						558755560,82	260172980,00