

AJ1-A1 CAPITAL PY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİS. SEN. SERBEST FON (HİS. SEN. YOĞUN FON)

Ekim-2025

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı

:

AJ1-A1 CAPITAL PY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİS. SEN. SERBEST FON

B-)Kurucunun Ünvanı

:

(HİS. SEN. YOĞUN FON)

C-)Yöneticinin Ünvanı

:

A1 CAPITAL PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.

D-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri

:

27.184.763,77

E-) Katılma Payı Sayısı

:

25.911.949,000

F-)Fonun Kuruluş Tarihi

:

10 Eylül 2025

G-)Fonun Süresi

:

Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)

:

1,049121

B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)

:

1,019727

C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)

:

2,88

D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı

:

5,09

E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı

:

F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi

a-)Hisse Senedi

:

83,50

b-)Hazine Bonosu

:

0,00

c-)Devlet Tahvili

:

0,00

d-)Özel Sektör Tahvili

:

0,00

e-)Kira Sertifikaları

:

0,00

f-)Finansman Bonusu

:

0,00

g-)TPP-TPP Borçlanma

:

1,20

h-)Opsiyon

:

0,00

i-) Varant

:

0,00

j-)Değerli Maden

:

0,00

k-)Mevduat

:

0,00

l-) Katilim Hesabı

:

0,00

m-)Diğer

:

0,00

n-)Teminat

:

15,30

o-)Yatırım Fonu

:

0,00

p-)Borsa Yatırım Fonu

:

0,00

r-)Repo-Trepo

:

0,00

s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri

:

0,00

t-) Vaad Sözleşmesi İşlemleri

:

0.00

G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı

a-)Hisse Senedi

:

2,31

b-)Hazine Bonosu

:

0,00

c-)Devlet Tahvili

:

0,00

d-)Opsiyon

:

0,00

e-)Varant

:

0,00

f-)Diğer

:

3,15

H-)Portföyün Ortalama Vadesi

:

0,00

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)

:

1.792.191,13

:

2.148.961,13

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)

:

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU																				
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CINSİ	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																				
AEFES	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.			TRAAEFES91A9			500,00	14,090280	20/10/25			80100511		14,530000	7.265,00	0,03	0,03	0,03	
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			TRAAKBNK91N6			1.500,00	60,066667	31/10/25			80100511		60,800000	91.200,00	0,39	0,33	0,34	
ALARK	TL	ALARKO HOLDİNG A.Ş.			TRAALARK91Q0			6.500,00	83,243369	07/10/25			80100511		80,700000	524.550,00	2,24	1,92	1,93	
ALARK	TL	ALARKO HOLDİNG A.Ş.			TRAALARK91Q0			-5.000,00	82,721487	31/10/25			80100511		80,700000	-403.500,00	-1,72	-1,47	-1,48	
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.			TRAARCLK91H5			3.100,00	123,263768	17/10/25			80100511		110,600000	342.860,00	1,46	1,25	1,26	
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.			TRAARCLK91H5			1.100,00	115,981745	31/10/25			80100511		110,600000	121.660,00	0,52	0,44	0,45	
ASTOR	TL	ASTOR ENERJİ A.Ş.			TREASTR00013			10.000,00	92,182705	16/10/25			80100511		98,200000	982.000,00	4,19	3,58	3,61	
ASTOR	TL	ASTOR ENERJİ A.Ş.			TREASTR00013			16.500,00	96,028126	31/10/25			80100511		98,200000	1.620.300,00	6,92	5,91	5,96	
CIMSA	TL	ÇİMSA ÇİMENTO SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRACIMSA91F9			14.000,00	47,181423	31/10/25			80100511		47,520000	665.280,00	2,84	2,43	2,45	
EREGL	TL	EREĞLİ			TRAEREGL91G3			14.500,00	29,745129	07/10/25			80100517		27,480000	398.460,00	1,70	1,45	1,47	

AJ1-A1 CAPITAL PY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİS. SEN. SERBEST FON (HİS. SEN. YOĞUN FON)																			
Ekim-2025																			
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)
EREGL	TL	DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş. EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAEREGL91G3			70.500,00	27,948506	31/10/25			80100517		27,480000	1.937.340,00	8,27	7,07	7,13
GARAN	TL	TÜRKİYE GARANTİ BANKASI A.Ş.			TRAGARAN91N1			5.000,00	119,050548	17/10/25			80100517		134,600000	673.000,00	2,87	2,46	2,48
GARAN	TL	TÜRKİYE GARANTİ BANKASI A.Ş.			TRAGARAN91N1			-4.000,00	121,258780	31/10/25			80100517		134,600000	-538.400,00	-2,30	-1,97	-1,98
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			10.500,00	288,834160	07/10/25			80100517		316,500000	3.323.250,00	14,19	12,16	12,22
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.			TRAGUBRF91E2			-2.000,00	298,957499	31/10/25			80100517		316,500000	-633.000,00	-2,70	-2,31	-2,33
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			16.100,00	172,029301	14/10/25			80100511		171,600000	2.762.760,00	11,80	10,08	10,16
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK İŞLETMELERİ A.Ş.			TREKOZA00014			1.000,00	89,125000	31/10/25			80100511		90,500000	90.500,00	0,39	0,33	0,33
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.			TREKOAL00014			13.500,00	27,043407	31/10/25			80100511		26,880000	362.880,00	1,55	1,32	1,33
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			TRAKRDMR91G7			21.000,00	27,369333	31/10/25			80100511		27,420000	575.820,00	2,46	2,10	2,12
PETKM	TL	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.			TRAPETKM91E0			4.200,00	17,110714	31/10/25			80100511		17,170000	72.114,00	0,31	0,26	0,27
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			7.200,00	219,670950	10/10/25			80100511		210,000000	1.512.000,00	6,46	5,52	5,56
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			TREPEGS00016			3.100,00	213,720843	31/10/25			80100511		210,000000	651.000,00	2,78	2,38	2,39
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			30.200,00	87,542547	16/10/25			80100511		81,550000	2.462.810,00	10,52	8,99	9,06
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			TRASAHOL91Q5			-9.500,00	84,602075	31/10/25			80100511		81,550000	-774.725,00	-3,31	-2,83	-2,85
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.			TRETAVH00018			500,00	257,000000	31/10/25			80100511		265,000000	132.500,00	0,57	0,48	0,49
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			500,00	95,491740	16/10/25			80100511		99,700000	49.850,00	0,21	0,18	0,18
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			14.000,00	99,329370	31/10/25			80100511		99,700000	1.395.800,00	5,96	5,09	5,13
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			100,00	259,465600	17/10/25			80100511		264,250000	26.425,00	0,11	0,10	0,10
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			TRATOASO91H3			9.900,00	263,843719	31/10/25			80100511		264,250000	2.616.075,00	11,17	9,55	9,62
ULKER	TL	ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ A.Ş.			TREULKR00015			5.000,00	105,761766	02/10/25			80100511		108,100000	540.500,00	2,31	1,97	1,99
ULKER	TL	ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ A.Ş.			TREULKR00015			-500,00	106,490407	31/10/25			80100511		108,100000	-54.050,00	-0,23	-0,20	-0,20
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			TREVKFB00019			9.000,00	26,175214	10/10/25			80100511		24,460000	220.140,00	0,94	0,80	0,81
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			TREVKFB00019			25.000,00	24,740813	31/10/25			80100511		24,460000	611.500,00	2,61	2,23	2,25
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			TRAYKBNK91N6			800,00	28,628925	17/10/25			80100511		33,600000	26.880,00	0,11	0,10	0,10
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			TRAYKBNK91N6			30.500,00	33,197608	31/10/25			80100511		33,600000	1.024.800,00	4,38	3,74	3,77
GRUP TOPLAMI								324.300,00											
GRUP TOPLAMI								324.300,00											
TPP																			
TPP			03/11/25	0		39,85		488.595,09	39,850000	31/10/25			327660	488.595,09	39,850000	488.595,09	100,00	1,78	1,80
GRUP TOPLAMI								488.595,09											
GRUP TOPLAMI								488.595,09											
TÜREV																			
Futures																			
Kısa																			
F_AEFES1125	TL				TRVXIST054M6			5,00	14,810000	31/10/25			80105125		14,850000	7.425,00	0,00	0,00	0,00
F_AKBNK1125	TL				TRVXIST054Z8			15,00	61,643300	31/10/25			80105125		62,270000	93.405,00	0,00	0,00	0,00
F_ALARK1125	TL				TRVXIST05504			15,00	82,560000	31/10/25			80105125		82,890000	124.335,00	0,00	0,00	0,00
F_ARCLK1125	TL				TRVXIST05512			42,00	113,683300	31/10/25			80105125		113,950000	478.590,00	0,00	0,00	0,00
F_ASTOR1125	TL				TRVXIST054O2			265,00	100,079500	31/10/25			80105125		101,000000	2.676.500,00	0,00	0,00	0,00

AJ1-A1 CAPITAL PY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİS. SEN. SERBEST FON (HİS. SEN. YOĞUN FON)
Ekim-2025

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 SÖZLEŞİM E NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
F_CIMSA1125	TL				TRVXIST05538			140,00	48,397900	31/10/25			80105125		48,560000	679.840,00	0,00	0,00	0,00
F_EREGL1125	TL				TRVXIST054U9			850,00	28,380800	31/10/25			80105125		28,240000	2.400.400,00	0,00	0,00	0,00
F_GARAN1125	TL				TRVXIST054Y1			10,00	135,750000	31/10/25			80105125		137,500000	137.500,00	0,00	0,00	0,00
F_GUBRF1125	TL				TRVXIST055J9			85,00	319,674100	31/10/25			80105125		324,250000	2.756.125,00	0,00	0,00	0,00
F_KCHOL1125	TL				TRVXIST055A8			161,00	173,106500	31/10/25			80105125		176,000000	2.833.600,00	0,00	0,00	0,00
F_KOZAA1125	TL				TRVXIST055C4			10,00	91,465000	31/10/25			80105125		92,630000	92.630,00	0,00	0,00	0,00
F_KOZAL1125	TL				TRVXIST055D2			135,00	27,749600	31/10/25			80105125		27,590000	372.465,00	0,00	0,00	0,00
F_KRDMD1125	TL				TRVXIST055E0			210,00	28,087600	31/10/25			80105125		28,150000	591.150,00	0,00	0,00	0,00
F_PETKM1125	TL				TRVXIST055P6			42,00	17,568600	31/10/25			80105125		17,630000	74.046,00	0,00	0,00	0,00
F_PGSUS1125	TL				TRVXIST055Q4			103,00	215,234500	31/10/25			80105125		215,250000	2.217.075,00	0,00	0,00	0,00
F_SAHOL1125	TL				TRVXIST055S0			207,00	82,414800	31/10/25			80105125		83,760000	1.733.832,00	0,00	0,00	0,00
F_TAVHL1125	TL				TRVXIST055M3			5,00	263,810000	31/10/25			80105125		270,950000	135.475,00	0,00	0,00	0,00
F_TCELL1125	TL				TRVXIST055N1			145,00	102,109000	31/10/25			80105125		102,250000	1.482.625,00	0,00	0,00	0,00
F_TOASO1125	TL				TRVXIST056F5			100,00	270,885000	31/10/25			80105125		273,100000	2.731.000,00	0,00	0,00	0,00
F_ULKER1125	TL				TRVXIST055W2			45,00	110,094400	31/10/25			80105125		110,950000	499.275,00	0,00	0,00	0,00
F_VAKBN1125	TL				TRVXIST055Z5			340,00	25,002400	31/10/25			80105125		25,240000	858.160,00	0,00	0,00	0,00
F_YKBNK1125	TL				TRVXIST056B4			313,00	34,113000	31/10/25			80105125		34,490000	1.079.537,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								3.243,00								24.054.990,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI								3.243,00								24.054.990,00	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																			

VIOP Nakit Teminatı	3.492.091,83		3.492.091,83	100,00	12,75
GRUP TOPLAMI	3.492.091,83		3.492.091,83	100,00	12,75
GRUP TOPLAMI	3.492.091,83		3.492.091,83	100,00	12,75
FON PORTFÖY DEĞERİ			27.398.530,92		100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	27.398.530,92	100,79 %
B-)HAZIR DEĞERLER	20.901,06	0,08 %
C-)ALACAKLAR	22.734.464,03	83,63 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-22.969.132,24	-84,49 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	27.184.763,77	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alimlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	14.627,43	0,0538 %
Fon Yönetim Ücreti	73.505,45	0,2704 %
Mevzuat Gereği Yapilmasi Zorunlu Tescil ve Ilan Giderleri	2.757,15	0,0101 %
Kayda Alma Ücreti	500,82	0,0018 %
Portföydeki Varliklariin Saklanmasi Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	5.640,71	0,0207 %
Fonun Mükellefi Oldugu Vergi Ödemeleri	1.446,00	0,0053 %
Bagimsiz Denetim Kuruluslarina Ödenen Denetim Ücreti	7.323,36	0,0269 %
Varliklariin Nakde Çevrilmesi ve Transferinde Ödenen Ücretler	168,00	0,0006 %
Diger Harcamalar	4.627,83	0,0170 %
Portföy Saklama Komisyonu Değişken Ücreti	6.790,12	0,0250 %
	117.386,87	0,4316 %

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