

KRS Mart 2018 Portföy Dağılım Raporu

1- FONU TANITICI BİLGİLER				
A. FONUN ADI:	Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon			
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
D. FON TUTARI	50,000,000.00			
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	70,819,383.19			
F. KATILMA PAYI SAYISI:	2,169,655,594.00			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/03/2012			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	0.032641	30/03/2018		
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.031353			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	4.11%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	5.94%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	15.43%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	2.12%			
Varant				
Devlet Tahvili				
Özel Sektör Tahvili	3.76%			
Finansman Bonosu	1.09%			
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo				
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları				
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi				
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası				
Kıymetli Madenler				
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	1.37%			
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	52.67%			
Opsiyon İşlemleri				
Yabancı Hisse Senetleri	38.91%			
Vadeli Mevduat TL				
Vadeli Mevduat Döviz	0.08%			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	26.05%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0.00%			

Devlet Borçlanma Senetleri	5.91%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,629.98			
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN				
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	568,016.63			
M. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	-			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ				
HALKB	100,000.00	895,000.00	1.24%	
MAVI	11,000.00	594,000.00	0.82%	
TOPLAM :	111,000.00	1,489,000.00	2.06%	
B) VARANTLAR:				
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:				
D) BANKA BONOLARI:				
E) FİNANSMAN BONOLARI:				
TRFEKSP61819	800,000.00	778,436.00	1.1%	
TOPLAM :	800,000.00	778,436.00	1.1%	
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:				
TRSAEST91911	400,000.00	400,563.28	0.6%	
TRSDGOZ71918	400,000.00	360,280.00	0.5%	
TRSHYTV22012	1,500,000.00	1,540,955.55	2.1%	
TRsvera51913	400,000.00	407,959.96	0.6%	
TOPLAM :	2,700,000.00	2,709,758.79	3.8%	
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
NO0010710882	426,743.00	1,744,853.99	2.4%	
NO0010710882	400,000.00	1,635,508.02	2.3%	
XS0847042024	400,000.00	1,591,248.74	2.2%	
XS0849728190	200,000.00	789,906.36	1.1%	
XS0861979440	400,000.00	1,549,927.45	2.2%	
XS0882347072	400,000.00	1,506,963.42	2.1%	

XS0927211754	500,000.00	1,906,528.92	2.6%	
XS1028943089	200,000.00	784,946.55	1.1%	
XS1132450427	700,000.00	2,907,030.12	4.0%	
XS1132825099	400,000.00	1,664,856.24	2.3%	
XS1132825099	200,000.00	832,428.12	1.2%	
XS1175854923	800,000.00	3,207,612.49	4.4%	
XS1188073081	200,000.00	755,053.37	1.1%	
XS1219733752	600,000.00	2,417,603.46	3.35%	
XS1261825977	600,000.00	2,596,204.31	0.0359	
XS1386178237	600,000.00	2,406,396.48	0.0333	
XS1390320981	450,000.00	1,802,753.80	2.50%	
XS1396282177	200,000.00	839,283.41	1.16%	
XS1412393172	200,000.00	788,350.50	1.09%	
XS1571399754	400,000.00	1,582,213.66	0.0219	
XS1655085485	500,000.00	1,913,222.31	0.0265	
XS1711581337	750,000.00	2,952,641.89	0.0409	
JE00B55Q3P39 - GENEL ENERGY PLC	100,000.00	930,468.00	0.0129	
US03761U1060 - APOLLO BD	691.16	14,247.06	0.0002	
US03761U1060 - APOLLO BD	4,703.84	96,961.47	0.0013	
US03761U1060 - APOLLO BD	35,000.00	721,464.03	0.01	
US03761U1060 - APOLLO BD	15,000.00	309,198.87	0.0043	
US03761U1060 - APOLLO BD	45,000.00	927,596.61	0.0128	
US03761U1060 - APOLLO BD	22,000.00	453,491.68	0.0063	
US03761U1060 - APOLLO BD	18,000.00	371,038.64	0.0051	
US03762U1051 - APOLLO COMMERCIA	5,500.00	390,506.72	0.0054	
US04010L1035 - ARES BD	265.77	16,655.55	0.0002	
US04010L1035 - ARES BD	1,643.23	102,979.65	0.0014	
US04010L1035 - ARES BD	13,000.00	814,697.56	0.0113	
US04010L1035 - ARES BD	6,000.00	376,014.26	0.0052	
US04010L1035 - ARES BD	18,000.00	1,128,042.77	1.6%	
US04010L1035 - ARES BD	6,000.00	376,014.26	0.5%	
US04010L1035 - ARES BD	6,000.00	376,014.26	0.5%	
US0925331086 - BLACKROCK	1,758.00	41,861.26	0.1%	
US0925331086 - BLACKROCK	23,000.00	547,672.94	0.8%	
US0925331086 - BLACKROCK	15,000.00	357,178.01	0.5%	
US0925331086 - BLACKROCK	20,000.00	476,237.34	0.7%	
US38147U1079 - GOLDMAN SACHS BD	988.00	74,635.95	0.1%	
US38147U1079 - GOLDMAN SACHS BD	5,000.00	377,712.28	0.5%	
US38147U1079 - GOLDMAN SACHS BD	10,000.00	755,424.57	1.1%	
US38147U1079 - GOLDMAN SACHS BD	6,000.00	453,254.74	0.0063	
US38147U1079 - GOLDMAN SACHS BD	4,800.00	362,603.79	0.005	
US4642872349 - I SHARES EMERGING MARKET ETF	10,000.00	1,906,528.92	0.0264	
US4642872349 - I SHARES EMERGING MARKET ETF	4,000.00	762,611.57	0.0106	
US4642872349 - I SHARES EMERGING MARKET ETF	7,000.00	1,334,570.24	0.0185	
USG0717XAA21 - BALLYROCK	500,000.00	1,382,115.00	0.0191	
USG0717XAB04 - BALLYROCK	500,000.00	2,054,849.60	0.0284	
USG3337MAG71 - ARES 2017-42X	500,000.00	1,791,813.38	0.0248	
USG5279CAB57 - KKR FINANCIAL CLO LTD	750,000.00	2,910,002.66	0.0403	
USG6868VAA01 - OZLM 2017-16X D	500,000.00	2,003,079.52	0.0277	
XS1319815202 - DRYDEN CLO	750,000.00	3,064,938.81	0.0424	
TOPLAM :	13,431,093.00	66,238,015.59	0.9169	

L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
O) VOB İŞLEMLERİ:				
BPM8	-2.00	1.41	0	
BZZ8	10.00	66.48	0	
CLZ8	5.00	61.91	0	
F_EURTRY0418	-650.00	4.93	0	
F_USDTRY0418	1,510.00	3.99	0	
TOPLAM :	873.00	138.72	0	
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
TL	1,027,331.76	1,027,331.76	0.0142	
TOPLAM :	1,027,331.76	1,027,331.76	0.0142	
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
FON PORTFÖY DEĞERİ	18,069,424.76	72,242,542.14		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	72,242,542.14	102.01%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	1,278,082.17	1.80%		
C. ALACAKLAR (+) :	0.00	0.00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0.00	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	2,701,241.12	3.81%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	70,819,383.19	30/03/2018		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	66,803.98			
37002Denetim Ücreti	428.80			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	38.80			
37006Saklama Giderleri	2,048.00			
37008Banka Masrafları	430.80			
370142BİST Endeks K. Öltücü Kullanım bedeli	377.60			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	1,961.00			
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	3,540.79			
37023VOB İşlemi Komisyonu	1,193.86			
37045Fon Saklama Ücreti	4,804.42			
37098Küsürat farkları	0.16			
TOPLAM	81,628.21			

6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI				
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI.				
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA				
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfai Tarihi	Nom. (1000 TL)		
8- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0

*** Kaldıraç ve risk limitlerine uyum raporu EK'tedir

KARE PORTFÖY SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_MART 2018

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

30.03.2018

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
30.03.2018	06.04.2016	30.03.2018	Tarihsel Benzetim	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com
Mutlak Risk					Görelî Risk				2013 Yaz
FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kıstas RMD	Kıstas RMD/FTD	Görelî RMD	Görelî RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
KRS-A	70,819,383.19	5,430,710.09	7.67%	20.00%				4,454,948.49	6.29%
KRS-B	17,933,952.03	835,700.69	4.66%	20.00%				1,091,856.40	6.09%

KALDIRAÇ RAPORU

30.03.2018

KarePortföy	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRS-A	70,819,383.19	17,098,302.47	8,015,087.40	0.24	7.00	0.11	-	1,028,748.70
KRS-B	17,933,952.03	4,007,130.67	2,124,577.43	0.22	7.00	0.12	-	144,286.04

DUYARLILIK ANALİZİ

30.03.2018

Hisse -%10					Hisse -%20					USDTRY 10%				
FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)
KRS-A	70,819,383.19	70,729,883.19	-89,500.00	-0.13	70,640,383.19	-179,000.00	-0.25	-0.25	78,452,242.67	7,632,859.48	10.78	10.78	78,452,242.67	7,632,859.48
KRS-B	17,933,952.03	17,911,287.49	-22,664.54	-0.13	17,888,622.95	-45,329.08	-0.25	-0.25	18,084,952.03	151,000.00	0.84	0.84	18,084,952.03	151,000.00
TL Gov 300 bps					US Gov 10yr 100 bps					US Gov 200 bps				
FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)
KRS-A	70,819,383.19	70,812,837.14	-6,546.05	-0.01	69,934,667.14	-884,716.05	-1.25	-1.25	67,829,415.31	-2,989,967.88	-4.22	-4.22	67,829,415.31	-2,989,967.88
KRS-B	17,933,952.03	17,932,294.34	-1,657.69	-0.01	17,709,910.89	-224,041.14	-1.25	-1.25	17,176,787.28	-757,164.75	-4.22	-4.22	17,176,787.28	-757,164.75
Likidite Senaryo (KRC, KUB, KYA)					Likidite Senaryo (KRS)					Likidite Senaryo (KRF)				
FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)
KRS-A	70,819,383.19	66,219,982.33	-4,599,400.86	-6.49	67,707,071.51	-3,112,311.68	-4.39	-4.39	69,157,328.31	-1,662,054.88	-2.35	-2.35	69,157,328.31	-1,662,054.88
KRS-B	17,933,952.03	17,110,460.65	-823,491.38	-4.59	17,478,871.74	-455,080.29	-2.54	-2.54	17,513,061.43	-420,890.60	-2.35	-2.35	17,513,061.43	-420,890.60