

KRT_Aralık 2018 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER				
A. FONUN ADI:	Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon			
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
D. FON TUTARI	0			
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	32106545,93			
F. KATILMA PAYI SAYISI:	5.987.228,00			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	02/11/2018			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZDİR			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	5,362506	31/12/2018		
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	5,127294			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	4,587%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-1,02%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-1,49%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi				
Varant				
Devlet Tahvili				
Özel Sektör Tahvili				
Finansman Bonosu				
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				
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	1			
Opsiyon İşlemleri				
Yabancı Hisse Senetleri				
Vadeli Mevduat TL				
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0,035			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0,00%			
Devlet Borçlanma Senetleri	0,8172			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	813,30			
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	19046864,65			
M. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	0,00000000%			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ				
B) VARANTLAR:				
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:				
D) BANKA BONOLARI:				
E) FİNANSMAN BONOLARI:				
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:				
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				

J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
NO0010710882	200.000,00	1.092.512,16	4,31%	
USM8931TAA71	400.000,00	2.129.954,04	8,40%	
XS0861979440	400.000,00	1.791.716,56	7,07%	
XS0874840688	200.000,00	1.048.637,61	4,14%	
XS1028943089	200.000,00	1.013.339,40	4,00%	
XS1082151868	400.000,00	2.099.155,25	8,28%	
XS1082151868	200.000,00	1.049.577,63	4,14%	
XS1117601796	200.000,00	1.048.627,05	4,14%	
XS1121459074	200.000,00	1.036.438,50	4,09%	
XS1219733752	600.000,00	3.074.999,56	12,13%	
XS1390320981	350.000,00	1.716.655,06	6,77%	
XS1390320981	600.000,00	2.942.837,25	11,61%	
XS1412393172	400.000,00	1.931.705,30	7,62%	
XS1508914691	300.000,00	1.468.471,83	5,79%	
XS1571399754	200.000,00	1.016.824,86	4,01%	
XS1711581337	200.000,00	888.200,83	3,50%	
TOPLAM :	5.050.000,00	25.349.652,88	100,00%	
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
O) VOB İŞLEMLERİ:				
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
FON PORTFÖY DEĞERİ	5050000	25349652,88		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	25349652,88	0,7895		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	14614428	0,4552		
C. ALACAKLAR (+) :	66012,5	0,0021		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0		
E. BORÇLAR (-) :	7923547,45	0,2468		
FON TOPLAM DEĞERİ:	32106545,93	31/12/2018		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	16156,68			
37002Denetim Ücreti	2603,62			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	38,8			
37006Saklama Giderleri	1580,91			
37008Banka Masrafları	701,5			
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	820,11			
37045Fon Saklama Ücreti	1162,06			
37098Küsürat farkları	0,01			
TOPLAM	23063,69			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa 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 TÜRKİYE ODAKLI SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_ARALIK_2018

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.12.2018										
Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi	
31.12.2018	05.01.2017	31.12.2018	Tarihsel Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com	
KRT	Mutlak Risk				Görel Risk				2013 Yaz	
	FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kıstas RMD	Kıstas RMD/FTD	Görel Risk	Görel Risk Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
	6.079.633,77	155.135,35	2,55%	20,00%	360.731,55	5,93%	0,43	1,75	274.829,56	4,52%

KALDIRAÇ RAPORU

31.12.2018								
	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT	6.079.633,77	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-
2.368.742,01	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-	-

DUYARLILIK ANALİZİ

31.12.2018													
		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 (%)
KRT	6.079.633,77	6.079.633,77	0,00	0,00	0,00	6.079.633,77	0,00	0,00	0,00	6.079.633,77	0,00	0,00	0,00
		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 (%)
KRT	6.079.633,77	6.079.633,77	0,00	0,00	-0,08	6.078.536,38	-1.097,39	-0,02	-1,94	6.045.891,23	-33.742,53	-0,56	-6,33
		Likidite Senaryo (KRC,KRT,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 (%)
KRT	6.079.633,77	6.045.891,23	-33.742,53	-0,56	-6,44	6.062.547,29	-17.086,48	-0,28	-3,38	6.062.547,29	-17.086,48	-0,28	-3,38

Senaryolar:

Duyarlılık:

ABD 10 yıllık faiz %1 yükseliş (100 bps şok) – ABD 10 yıllık faiz %2 yükseliş (tüm verim eğrisine 200 bps paralel şok) - USDTRY %10 yükseliş - TL gösterge faiz %3 yükseliş (TL hazine verim eğrisine 300 bps yukarı yönlü şok)

Likidite :

Likidite riski, aşağıda yer verilen risk faktörlerine eşzamanlı şok uygulanarak hesaplanacaktır.

TR Hisse %15 Aşağı yönlü+ TR Bono %4 Faiz yukarı yönlü + Yurtdışı Tahvil %2 Faiz yukarı yönlü + Varant %50 İskonto + ViOP (Grup bazında endeks) %2 ters yönlü

Benchmark :

%40 BİST-KYD EUROBOND USD + %40 BIST-KYD ÖSBA EUROBOND USD + %20 BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD