

KRT_Mayıs 2019 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	0,00			
E. FON TOPLAM DEĞERİ	46.525.398,29			
F. TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	7.623.850,00			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	02/11/2018			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZDİR			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU PAY FİYATI	6,102612	31/05/2019		
B. ÖNCEKİ PAY FİYATI:	6,197563			
C. AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	-1,53%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	13,80%			
E. YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	12,10%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi				
Varant				
Devlet Tahvili				
Özel Sektör Tahvili				
Finansman Bonosu				
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo				
Devlet Tahvili Ters Repo				
Kuponlar Repo				
Kuponlar Ters Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Hazine Bonosu Ters Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Setifikaları				
Katılım Hesabı				
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası				
Kıymetli Madenler				
VIOP İşlemleri				
VIOP Nakit Teminat	0,0002			
Yabancı Sabit Getiriliiler				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	0,9998			
Opsiyon İşlemleri				
Yabancı Hisse Senetleri				
Forward				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	7,60%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0,00%			
Devlet Borçlanma Senetleri	5,13%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	629,612			
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN				
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	0			
M. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	0			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ:				
B) VARANT:				
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:				
D) BANKA BONOLARI:				
E) FİNANSMAN BONOLARI:				
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:				

G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
NO0010710882	200000	1.248.468,62	2,78%	
USM0375YAK49	200000	1.078.725,37	2,40%	
USM8931TAA71	600000	3.482.702,40	7,76%	
XS0861979440	400000	2.116.515,43	4,71%	
XS0874840688	800000	4.695.041,97	10,46%	
XS0882347072	800000	4.544.570,68	10,12%	
XS1028943089	400000	2.212.593,86	4,93%	
XS1082151868	400000	2.409.299,09	5,37%	
XS1117601796	400000	2.348.880,81	5,23%	
XS1121459074	400000	2.319.199,18	5,16%	
XS1219733752	600000	3.458.436,62	7,70%	
XS1390320981	950000	5.235.867,05	11,66%	
XS1412393172	400000	2.191.704,19	4,88%	
XS1508914691	600000	3.277.814,80	7,30%	
XS1571399754	200000	1.118.523,60	2,49%	
XS1605397394	200000	1.056.733,78	2,35%	
XS1613091500	200000	1.109.098,63	2,47%	
XS1711581337	200000	988.789,59	2,20%	
TOPLAM :	7950000	44.892.965,67	99,98%	
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) VOB İŞLEMLERİ:				
O) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
P) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
TL	9525,99	9.525,99	0,02%	
TOPLAM :	9525,99	9.525,99	0,02%	
R) ÖDÜNC TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) REPO TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
T) FORWARD İŞLEMLERİ:				
U) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER:				
V) DİĞER:				
FON PORTFÖY DEĞERİ	7959525,99	44.902.491,66		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	44902491,66	96,51%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	1675834,54	3,60%		
C. ALACAKLAR (+) :	0,00	0,00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0,00	0,00%		
E. BORÇLAR (-) :	52.927,91	0,11%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	46.525.398,29	31/05/2019		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	44.754,63			
37002Denetim Ücreti	598,72			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	122,90			
37006Saklama Giderleri	1.638,83			
37008Banka Masrafları	199,75			
37014BİST Endeks K. Öltücü Kullanım bedeli	382,08			
37045Fon Saklama Ücreti	3.218,99			
TOPLAM	50915,9			

6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI				
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM.				
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA				
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal		
8- ÖDÜNC İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
Alınan Ödünçler				
9- REPO İLE SAĞLANAN BORÇ TUTARI:				
	Nom. Değ.(1000 TL)	Rayiç Değ.(1000 TL)		
10-KREDİLİ MENKUL KIYMET ALIM İŞLEMLERİ:				
11- BANKA KREDİLERİ:				
	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Geri Dönüş Tutarı	

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

KARE PORTFÖY TÜRKİYE ODAKLI SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_MAYIS_2019

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.05.2019										
Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi	
31.05.2019	06.06.2017	31.05.2019	Tarihsel Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com	
Mutlak Risk					Görel Risk				2013 Yaz	
FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kistas RMD	Kistas RMD/FTD	Görel RMD	Görel RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD	
KRT	7.937.726,83	253.484,88	3,19%	20,00%	519.640,92	6,55%	0,49	1,75	367.009,02	4,62%

KALDIRAÇ RAPORU

31.05.2019									
FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD		
KRT	7.937.726,83	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-	-

DUYARLILIK ANALİZİ

31.05.2019													
		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	7.937.726,83	7.937.726,83	0,00	0,00	0,00	7.937.726,83	0,00	0,00	0,00	7.937.726,83	0,00	0,00	0,00
		TL Gov 300 bps				US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps			
KRT	7.937.726,83	7.937.726,83	0,00	0,00	-0,07	7.935.325,86	-2.400,97	-0,03	-1,94	7.894.439,60	-43.287,23	-0,55	-6,18
		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	7.937.726,83	7.894.439,60	-43.287,23	-0,55	-6,27	7.915.793,59	-21.933,24	-0,28	-3,28	7.915.793,59	-21.933,24	-0,28	-3,28

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