

KRS_Şubat 2020 Aylık Rapor

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. FON TOPLAM DEĞERİ	259.905.074,69			
F. TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	4.681.094.402,04			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/03/2012			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU PAY FİYATI	0,055522	28/02/2020		
B. ÖNCEKİ PAY FİYATI:	0,055009			
C. AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	0,93%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	3,44%			
E. YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	21,64%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	0,77%			
Varant				
Devlet Tahvili				
Özel Sektör Tahvili	1,41%			
Finansman Bonosu	0,35%			
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	0,52%			
Kıymetli Madenler				
ViOP İşlemleri				
ViOP Nakit Teminat	1,87%			
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	72,40%			
Opsiyon İşlemleri				
Yabancı Hisse Senetleri	22,69%			
Forward				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	36,07%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0,00%			
Devlet Borçlanma Senetleri	20,78%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	2.041,57			
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:				
EREGL	60000	495000	0,19%	
HALKB	100000	598000	0,23%	
MAVI	11000	588500	0,23%	
TOPLAM :	171000	1681500	0,65%	
B) VARANT:				
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:				
D) BANKA BONOLARI:				
E) FİNANSMAN BONOLARI:				
TRFLDFK62013	750000	724702,35	0,28%	
TOPLAM :	750000	724702,35	0,28%	
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:				
TRFDGOZ71915	245.452,00	245452	0,10%	
TRSAEST91911	500.000,00	536981,25	0,21%	
TRSAEST91911	-500.000,00	-536981,25	-0,21%	
XS0221762932	3.000.000,00	2859750	1,11%	
TOPLAM :	3245452	3105202	1,20%	
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
NO0010710882	186.743,00	1241819,249	0,48%	
NO0010710882	2.209.495,00	14692884,98	5,69%	
NO0010823347	1.100.000,00	6986829,498	2,71%	
NO0010843782	800.000,00	5433268,219	2,10%	
NO0010852643	1.000.000,00	6293949,087	2,44%	
US040114GW47	1.500.000,00	4952859,098	1,92%	
US05616JAN37	1.000.000,00	4786534,179	1,85%	
US09626FAL58	1.000.000,00	5456627,796	2,11%	
US14314NAC56	1.000.000,00	4748992,002	1,84%	
US60937GAD88	300.000,00	2072832,468	0,80%	
US67590DAJ54	1.000.000,00	5205474,99	2,02%	
US900123CM05	500.000,00	2727317,754	1,06%	
US900123CM05	1.000.000,00	5454635,508	2,11%	
USG13545AC52	1.000.000,00	5880300,291	2,28%	
USG3333YAA85	1.000.000,00	6317233,953	2,45%	
USG6868VAA01	1.000.000,00	5643591,573	2,19%	
XS0847042024	500.000,00	3121790,778	1,21%	
XS0861979440	600.000,00	3701285,098	1,43%	
XS1003016018	800.000,00	5266663,135	2,04%	
XS1079527211	700.000,00	4414044,808	1,71%	
XS1121459074	600.000,00	3807038,236	1,47%	
XS1188073081	700.000,00	4343530,265	1,68%	
XS1261825977	1.354.167,00	8992912,674	3,48%	
XS1386178237	600.000,00	3815256,424	1,48%	
XS1396282177	650.000,00	4212957,577	1,63%	
XS1571399754	200.000,00	1261554,117	0,49%	
XS1584113184	500.000,00	3157247,279	1,22%	
XS1613091500	300.000,00	1893750,681	0,73%	
XS1655085485	500.000,00	2387445,873	0,92%	
XS1711581337	550.000,00	3395515,584	1,32%	
XS1747548532	1.000.000,00	6246569,988	2,42%	

XS1750996206	800.000,00	4927675,332	1,91%	
XS1881358979	2.000.000,00	13134905,75	5,09%	
XS1939101579	3.000.000,00	18930782,84	7,33%	
XS1958649854	200.000,00	1366062,074	0,53%	
AAPL	800	1293144,334	0,50%	
AAPL	860	1390130,159	0,54%	
AINV	8.066,99	757884,2802	0,29%	
AINV	50.689,00	4762172,295	1,84%	
AINV	15.000,00	1409232,465	0,55%	
AINV	7.828,00	735431,4491	0,28%	
ARCC US	135,7	14244,2491	0,01%	
ARCC US	12.413,30	1303007,641	0,50%	
ARCC US	13.000,00	1364592,762	0,53%	
ARCC US	6.000,00	629812,044	0,24%	
ARCC US	18.000,00	1889436,132	0,73%	
ARCC US	6.000,00	629812,044	0,24%	
ARCC US	6.000,00	629812,044	0,24%	
ARCC US	13.000,00	1364592,762	0,53%	
ARES	500.000,00	1839218,023	0,71%	
ARI US	5.500,00	560206,482	0,22%	
ARI US	8.000,00	814845,792	0,32%	
ARI US	13.000,00	1324124,412	0,51%	
ARI US	8.500,00	865773,654	0,34%	
ATH USD	5.230,00	1360092,059	0,53%	
ATH USD	5.400,00	1404301,552	0,54%	
BALLYROCK	500.000,00	2089110,084	0,81%	
DIS US	1.720,00	1239086,089	0,48%	
DIS US	2.000,00	1440797,778	0,56%	
DRYD	750.000,00	3404358,144	1,32%	
FACEBOOK	1.135,00	1324737,352	0,51%	
FACEBOOK	1.150,00	1342244,894	0,52%	
FACEBOOK	1.250,00	1458961,841	0,57%	
GSBD	4.963,00	606550,1516	0,23%	
GSBD	5.000,00	611072,085	0,24%	
GSBD	10.000,00	1222144,17	0,47%	
GSBD	6.000,00	733286,502	0,28%	
GSBD	4.800,00	586629,2016	0,23%	
GSBD	735	89827,5965	0,03%	
GSBD	704,98	86158,7197	0,03%	
JPM	1.800,00	1314984,791	0,51%	
JPM	1.810,00	1322290,262	0,51%	
JPM	2.000,00	1461094,212	0,57%	
KKR	750.000,00	3396376,315	1,32%	
NVDA US	1.000,00	1541159,286	0,60%	
OXLC US	16.377,97	807583,4191	0,31%	
OXLC US	5.000,00	246545,64	0,10%	
OXLC US	20.000,00	986182,56	0,38%	
OXLC US	25.000,00	1232728,2	0,48%	
OXLC US	1.000,00	49309,128	0,02%	
OXLC US	20.000,00	986182,56	0,38%	
OXLC US	639	31508,5328	0,01%	
OXLC US	200	9861,8256	0,00%	
TSLX US	1.144,00	151351,629	0,06%	
TSLX US	10.000,00	1323003,75	0,51%	
TSLX US	15.000,00	1984505,625	0,77%	
TSLX US	489,99	64825,8607	0,03%	
TSLX US	200	26460,075	0,01%	
TOPLAM :	34.014.946,93	245784924,1	95,21%	
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				

N) VOB İŞLEMLERİ:				
F_EURTRY0420	-560	7,0332	0,00%	
F_USDTRY0420	3000	6,3739	0,00%	
TOPLAM :	3000	13,4071	0,00%	
O) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
P) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
TL	4544443,53	4544443,53	1,76%	
TOPLAM :	4.544.443,53	4.544.443,53	1,76%	
R) ÖDÜNÇ TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
S) REPO TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
T) FORWARD İŞLEMLERİ:				
U) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
V) DİĞER:				
BPP	2.303.184,37	2303184,37	0,89%	
TOPLAM :	2.303.184,37	2303184,37	0,89%	
FON PORTFÖY DEĞERİ	45.029.026,83	258143956,3		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	258.143.956,32	99,32%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	7.561.208,90	2,91%		
C. ALACAKLAR (+) :	67.999,21	0,03%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0,00%		
E. BORÇLAR (-) :	5.868.089,74	2,26%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	259.905.074,69	28/02/2020		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	219.591,46			
37002Denetim Ücreti	2.756,32			
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	61,47			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	14.558,33			
37006Saklama Giderleri	9.593,39			
370142BİST Endeks K. Öltüçü Kullanım bedeli	273,56			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	1.327,82			
37023VOB İşlemi Komisyonu	10.763,78			
37045Fon Saklama Ücreti	15.790,99			
37098Küsürat farkları	0,19			
TOPLAM	274.717,31			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal			
OXLC US Bds:%2	86.637,00			
AAPL Tem:%62	800			

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal	Satış Değeri
Borsa Para Piyasası Satışı		03/02/2020	1.070.000,00	1.070.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		04/02/2020	2.276.000,00	2.276.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		04/02/2020	48.000,00	48.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		05/02/2020	3.747.000,00	3.747.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		06/02/2020	3.748.000,00	3.748.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		07/02/2020	3.749.000,00	3.749.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		10/02/2020	3.752.000,00	3.752.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		26/02/2020	2.300.000,00	2.300.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		27/02/2020	2.264.000,00	2.264.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		27/02/2020	37.000,00	37.000,00
Borsa Para Piyasası Satışı		28/02/2020	2.301.000,00	2.301.000,00
TOPLAM :			25.292.000,00	25.292.000,00
Euro Tahvil (Türk)	XS1439838548	05/02/2020	800.000,00	795.466,70
Euro Tahvil (Türk)	XS1439838548	05/02/2020	200.000,00	198.866,67
Euro Tahvil (Türk)	XS1439838548	05/02/2020	400.000,00	397.733,33
Euro Tahvil (Türk)	XS1439838548	05/02/2020	200.000,00	198.866,67
Euro Tahvil (Türk)	US60937GAD88	26/02/2020	200.000,00	223.279,17
Euro Tahvil (Türk)	XS1079527211	26/02/2020	200.000,00	204.750,00
TOPLAM :			2.000.000,00	2.018.962,54
Finansman Bonosu	TRFHYTEV62015	05/02/2020	1.500.000,00	1.422.521,31
TOPLAM :			1.500.000,00	1.422.521,31
Özel Sektör Tahvili	XS0221762932	19/02/2020	2.500.000,00	2.387.500,00
Özel Sektör Tahvili	TRFDGOZ71915	28/02/2020	19.999,00	19.999,00
TOPLAM :			2.519.999,00	2.407.499,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0420	28/02/2020	1	7.025,50
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0420	28/02/2020	10	70.255,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0420	28/02/2020	549	3.856.999,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	100	622.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.125,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1.000,00	6.225.000,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1.000,00	6.221.800,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.109,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	100	622.250,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.224,40
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	11	68.476,10
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.109,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.109,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	100	622.350,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	77	479.286,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1.000,00	6.221.800,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.109,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.109,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	20	124.472,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	2	12.450,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	630	3.919.734,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.109,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.109,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	4	24.894,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	100	622.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.225,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	11	68.476,10
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	768	4.780.800,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1.000,00	6.225.000,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	20	124.494,00
TOPLAM :			6.545,00	41.181.900,10
8- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal		
XS1175854923	03/02/2020	800.000,00		
TRSHYTEV22012	04/02/2020	1.200.000,00		

9- PORTFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal	Alış Değeri
Euro Tahvil (Türk)	XS1439838548	03/02/2020	200.000,00	198.611,11
Euro Tahvil (Türk)	XS1439838548	04/02/2020	200.000,00	200.038,89
Euro Tahvil (Türk)	NO0010710882	10/02/2020	75.000,00	80.193,49
Euro Tahvil (Türk)	NO0010710882	14/02/2020	850.000,00	915.589,73
Euro Tahvil (Türk)	XS1747548532	20/02/2020	500.000,00	514.159,72
Euro Tahvil (Türk)	US900123CM05	28/02/2020	1.000.000,00	878.048,61
TOPLAM :			2.825.000,00	2.786.641,55
Özel Sektör Tahvili	XS0221762932	10/02/2020	5.000.000,00	4.750.000,00
TOPLAM :			5.000.000,00	4.750.000,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	24	164.580,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	20	137.150,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	75	514.312,50
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	20	137.150,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	10	68.575,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	240	1.645.800,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	2	12.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0420	28/02/2020	3.000,00	19.035.000,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	50	312.400,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.225,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	50	312.245,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	20	125.196,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	17	106.297,60
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.250,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.230,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.146,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	11	68.501,40
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.250,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	200	1.250.000,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.249,70
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	8	50.000,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	15	93.750,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	50	312.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.243,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.238,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	10	62.330,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.245,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	50	312.200,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	25	156.062,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	17	106.420,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	65	406.822,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.252,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.227,80
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	150	938.985,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	7	43.778,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	100	624.980,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	10	62.494,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	50	312.395,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.250,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.249,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	25	156.200,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	20	124.720,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.232,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	3	18.690,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.240,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.235,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	10	62.318,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	7	43.750,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	3	18.750,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	2	12.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	3	18.765,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	2	12.505,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	86	537.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.245,00

Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1.000,00	6.244.900,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	50	312.150,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	25	156.225,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	3	18.739,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	100	624.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.229,30
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	4	24.910,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	500	3.130.000,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	46	286.672,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.150,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	1	6.227,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	100	625.000,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	2	12.500,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.249,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	100	685.750,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	70	480.025,00
Vob Sözleşmesi	F_EURTRY0220	28/02/2020	1	6.857,50
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	50	312.185,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	5	31.204,00
Vob Sözleşmesi	F_USDTRY0220	28/02/2020	2	12.470,00
TOPLAM :			6.560,00	41.623.074,80
Yabancı Hisse	DIS US	26/02/2020	2.000,00	254.360,80
Yabancı Hisse	JPM	26/02/2020	2.000,00	254.762,00
Yabancı Hisse	ATH USD	26/02/2020	5.400,00	250.228,44
Yabancı Hisse	FACEBOOK	26/02/2020	1.250,00	248.237,49
Yabancı Hisse	ARI US	26/02/2020	8.500,00	149.195,40
Yabancı Hisse	TSLX US	26/02/2020	200	4.410,00
Yabancı Hisse	AINV	26/02/2020	7.828,00	128.371,76
Yabancı Hisse	OXLC US	26/02/2020	200	1.770,00
Yabancı Hisse	AAPL	26/02/2020	860	250.106,80
TOPLAM :			28.238,00	1.541.442,69
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal	Tutar
Verilen Ödünçler				
Alınan Ödünçler				
11- REPO İLE SAĞLANAN BORÇ TUTARI:				
	Nom. Değ.(1000 TL)	Rayiç Değ.(1000 TL)		
12-KREDİLİ MENKUL KIYMET ALIM İŞLEMLERİ:				
13- BANKA KREDİLERİ:				
	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Geri Dönüş Tutarı	

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

KARE PORTFÖY SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_ŞUBAT 2020

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

28.02.2020

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
28.02.2020	28.02.2018	28.02.2020	Tarihsel Benzetim1	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	259.905.074,70	41.541.909,71	15,98%	20,00%				15.570.267,14	5,99%
KRS-B	41.745.783,69	1.861.083,54	4,46%	20,00%				2.992.376,57	7,17%

KALDIRAÇ RAPORU

28.02.2020

	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRS-A	259.905.074,70	28.321.390,80	28.321.390,80	0,11	7,00	0,11	-	2.504.494,49
KRS-B	41.745.783,69	5.252.892,40	3.257.738,68	0,13	7,00	0,08	-	217.408,09

DUYARLILIK ANALİZİ

28.02.2020

		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 (%)
KRS-A	259.905.074,70	259.795.774,70	-109.300,00	-0,04		259.686.474,70	-218.600,00	-0,08		286.454.706,34	26.549.631,64	10,22	
KRS-B	41.745.783,69	41.728.228,00	-17.555,69	-0,04		41.710.672,30	-35.111,39	-0,08		42.045.783,69	300.000,00	0,72	
		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 (%)
KRS-A	259.905.074,70	259.875.263,95	-29.810,75	-0,01		258.822.887,58	-1.082.187,12	-0,42		255.018.245,65	-4.886.829,05	-1,88	
KRS-B	41.745.783,69	41.740.995,51	-4.788,18	-0,01		41.571.905,62	-173.878,07	-0,42		40.960.845,93	-784.937,76	-1,88	
		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 (%)
KRS-A	259.905.074,70	249.602.578,96	-10.302.495,74	-3,96		251.971.858,48	-7.933.216,22	-3,05		257.192.274,80	-2.712.799,90	-1,04	
KRS-B	41.745.783,69	40.868.163,60	-877.620,09	-2,10		41.245.267,95	-500.515,74	-1,20		41.310.045,26	-435.738,43	-1,04	

Senaryo	Senaryo Tanımı
Hisse -%10:	Hisse senedi piyasası aşağı yönlü 10% şok
Hisse -%20:	Hisse senedi piyasası aşağı yönlü 20% şok
USDTRY 10%:	USDTRY kuruna yukarı yönlü 10% şok
US Gov 10yr 100 bps:	US Hazine verim eğrisine yukarı yönlü 100 baz puan nonparalel şok (VKGS >= 10 yıl)
US Gov 200 bps:	US hazine verim eğrisine 200 baz puan yukarı yönlü paralel şok.
TL Gov 300 bps:	TL Hazine verim eğrisine 300 baz puan yukarı yönlü paralel şok
Likidite Senaryo (KRS)	Eşzamanlı olarak; Hisse Piyasası - %8, USD faiz +100 bps, USDTRY -2% (VIOP),TL faiz +200 bps, EURUSD 2% (VIOP), Warrant -25%
KRS-A	Kare Portföy Serbest Fon (TRY) Gösterim amaçlıdır. Karşılaştırma Ölçütü : Yok (Eşik değer = KYD 1 AYLIK MEVDUAT USD ENDEKSİ)
KRS-B	Kare Portföy Serbest Fon (USD) Karşılaştırma Ölçütü : Yok (Eşik değer = KYD 1 AYLIK MEVDUAT USD ENDEKSİ)
	RMD Yöntemi
KRS-B	Mutlak RMD