

KRS Ağustos 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. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	75.032,25		
F. KATILMA PAYI SAYISI:	1.115.000,04		
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/03/2012		
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ		
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER			
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	0,067293	31/08/2020	
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0,058646		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	14,74%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	25,38%		
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	32,88%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:			
Hisse Senedi			
Varant			
Devlet Tahvili			
Özel Sektör Tahvili	0,00%		
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	100,00%		
Yabancı Sabit Getirililer			
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)			
Opsiyon İşlemleri			
Yabancı Hisse Senetleri			
Vadeli Mevduat TL			
Vadeli Mevduat Döviz			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	36,07%		
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:			
Hisse Senedi	0		
Devlet Borçlanma Senetleri	0,00%		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	0		
J. AYLIK KORELASYON :			
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :			
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	0,00000000%		
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:			
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	1.349.757,68	1.349.757,68	100,0%
TOPLAM :	1.349.757,68	1.349.757,68	100,0%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
FON PORTFÖY DEĞERİ	1349757,68	1.349.757,68	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	1349757,68	17,99	
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	121133,38	1,61	
C. ALACAKLAR (+) :	0,01	-	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0,00	-	
E. BORÇLAR (-) :	1.395.858,82	18,60	
FON TOPLAM DEĞERİ:	75.032,25	31/08/2020	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	1.110,94		
37002Denetim Ücreti	-2.761,20		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	372,33		
37006Saklama Giderleri	13798,61		
37008Banka Masrafları	1.163,71		
370142BİST Endeks K. Öltüçü Kullanım bedeli	273,56		
37016Cari Yıl Vergileri	1.382.430,04		
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	20,56		
37045Fon Saklama Ücreti	79,72		
TOPLAM	1.396.488,27		
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI			
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM.			
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA			
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR			
Açıklama	Nominal Değeri		
OXLC US Bds:%2	3301		
TOPLAM :			438900,0%
8- İTFALAR			
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nom. (1000 TL)	

9- PORFÖYE ALIŞLAR:			
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nom. (1000 TL)
Yabancı Hisse	TSLX	07/08/2020	1034
Yabancı Hisse	OXLC US	12/08/2020	3301
TOPLAM :			4335
10- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal
Verilen Ödünçler			
TOPLAM :			0
Alınan Ödünçler			
TOPLAM :			0

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

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

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.08.2020									
Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.08.2020	29.08.2018	31.08.2020	Tarihsel Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com
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
KRS-A	75.032,25	11.057,82	14,74%	20,00%				8.013,29	10,68%
KRS-B	10.241,77	19.190,99	187,38%	20,00%				16.408,92	160,22%

KALDIRAÇ RAPORU

31.08.2020									
	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD	
KRS-A	75.032,25	-	-	0,00	7,00	0,00	-	-	
KRS-B	10.241,77	-	-	0,00	7,00	0,00	-	-	

DUYARLILIK ANALİZİ

31.08.2020													
		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	75.032,25	75.032,25	0,00	0,00		75.032,25	0,00	0,00		87.026,02	11.993,77	15,98	
KRS-B	10.241,77	10.241,77	0,00	0,00		10.241,77	0,00	0,00		10.241,77	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 (%)
KRS-A	75.032,25	75.032,25	0,00	0,00		75.032,25	0,00	0,00		75.032,25	0,00	0,00	
KRS-B	10.241,77	10.241,77	0,00	0,00		10.241,77	0,00	0,00		10.241,77	0,00	0,00	
		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	75.032,25	72.633,50	-2.398,75	-3,20		72.633,50	-2.398,75	-3,20		75.032,25	0,00	0,00	
KRS-B	10.241,77	10.241,77	0,00	0,00		10.241,77	0,00	0,00		10.241,77	0,00	0,00	

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