

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon
Ocak-2021

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon
B-)Kurucunun Ünvanı	:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.S
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.S
D-)Fon Tutarı	:	1.000.000.000,00
E-)Fon Pay Sayısı	:	10.000.000.000,00
F-)Fon Toplam Değeri	:	11.896.736,78
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	184.770.515,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	05 Mart 2012
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	0,064387
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	0.008794
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	0,067477
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	-4,58
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	-4,58
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	17,05
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	15,90
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) TPP	:	0,00
g-) Opsiyon	:	0,01
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	0,00
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	84,09
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	1,265
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı		
a-)Hisse Senedi	:	0,11
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,03
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ				
AKBNK		45.000,00	287.100,00	5,70
EEM		4.000,00	1.567.554,56	68,69
GARAN		30.000,00	279.300,00	5,54
ISCTR		45.000,00	276.300,00	5,48
SISE		40.000,00	289.200,00	5,74

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon
Ocak-2021

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
TCELL		20.000,00	318.800,00	6,32
	TOPLAM:	184.000,00	3.018.254,56	97,47
TÜREV				
S&P 500 INDEX MAR2021 3500 P	19/03/21	-1,00	-63.331,84	-1,26
S&P 500 INDEX MAR2021 3800 C	19/03/21	1,00	62.189,67	1,23
	TOPLAM:	0,00	-1.142,17	-0,03
VOB Nakit Teminatı				
		32.138,96	32.138,96	0,27
		272.005,33	1.991.514,22	2,29
	TOPLAM:	304.144,29	2.023.653,18	2,56
PORTFÖY DEĞERİ:		488.144,29	5.040.765,57	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	5.040.765,57	42,37 %
B-)HAZIR DEĞERLER	8.463.258,50	71,14 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-1.607.287,29	-13,51 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	11.896.736,78	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	327,56	0,0028 %
Fon Yönetim Ücreti	6.152,76	0,0517 %
Kayda Alma Ücreti	113,89	0,0010 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	654,08	0,0055 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	64,10	0,0005 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	3.262,00	0,0274 %
Diğer Harcamalar	1.380,02	0,0116 %
BİST KYD Ücreti	360,00	0,0030 %
TOPLAM:	12.314,41	0,1035 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
USD	0,000	0,00	184.770.515,000	1.671.014,92

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

KARE PORTFÖY SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_OCAK 2021

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

29.01.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
29.01.2021	30.01.2019	29.01.2021	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	
KRS-A	11.896.736,78	3.360.542,02	28,25%	20,00%				1.155.880,95	9,72%	
KRS-B	1.624.882,10	466.683,84	28,72%	20,00%				228.546,74	14,07%	

KALDIRAÇ RAPORU

29.01.2021

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraç İşlem RMD
KRS-A	11.896.736,78	18.551.432,77	9.201.054,49	1,56	7,00	0,77	6.099.681,20
KRS-B	1.624.882,10	1.439.013,46	1.335.815,98	0,89	7,00	0,82	413.510,68

DUYARLILIK ANALİZİ

29.01.2021

		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	11.896.736,78	11.751.666,78	-145.070,00	-1,22	11.606.596,78	-290.140,00	-2,44		13.303.318,50	1.406.581,72	11,82	
	KRS-B	1.624.882,10	1.605.068,12	-19.813,98	-1,22	1.585.254,15	-39.627,95	-2,44		1.624.882,10	0,00	0,00	
		US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps				TL Gov 300 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	11.896.736,78	11.896.747,75	10,97	0,00	11.898.421,89	1.685,11	0,01		11.896.736,78	0,00	0,00	
	KRS-B	1.624.882,10	1.624.883,60	1,50	0,00	1.625.112,26	230,16	0,01		1.624.882,10	0,00	0,00	
		SP500 -%5				Likidite Senaryo (KRC,KRT,KUB,KYA)				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	11.896.736,78	11.899.108,08	2.371,30	0,02	11.399.466,84	-497.269,94	-4,18		11.781.505,06	-115.231,72	-0,97	
	KRS-B	1.624.882,10	1.625.205,98	323,88	0,02	1.595.391,29	-29.490,81	-1,81		1.609.143,50	-15.738,60	-0,97	
		Likidite Senaryo (KPB)											
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)								
	KRS-A	11.896.736,78	11.679.541,01	-217.195,77	-1,83								
	KRS-B	1.624.882,10	1.595.217,03	-29.665,07	-1,83								

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)
KRS-B	RMD Yöntemi Mutlak RMD