

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

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon
B-)Kurucunun Ünvanı	:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D-)Fon Tutarı	:	1.000.000.000,00
E-)Fon Pay Sayısı	:	10.000.000.000,00
F-)Fon Toplam Değeri	:	16.976.476,53
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	257.979.332,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	05 Mart 2012
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	0,065806
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	0.008928
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	0,064387
Önceki Ay Pay Fiyatı (USD)	:	0.008794
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,20
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	1,52
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	-2,48
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	18,52
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	22,19
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	5,22
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) TPP	:	0,00
g-) Opsiyon	:	0,10
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	0,00
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	72,49
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	2,196
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,03
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,07
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	174,70
I-)KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ (USD)	:	713.502,320000
J-)KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI (USD)	:	23.027,550000

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

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	İHRAÇÇI KURUM	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
HİSSE SENETLERİ					
AKBNK	AKBANK T.A.Ş.		85.000,00	515.100,00	3,06
EEM	ISHARES, INC		7.250,00	2.891.012,03	34,09
GARAN	GARANTI BANKASI		60.000,00	535.200,00	3,18
ISCTR	T.IŞ BANKASI A.Ş.		85.000,00	487.050,00	2,90
RSP	INVESCO S&P 500 EQUAL WEIGHT		1.100,00	1.098.293,42	6,53
SISE	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.		70.000,00	499.100,00	2,97
TCELL	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.		35.000,00	554.750,00	3,30
	TOPLAM:		343.350,00	6.580.505,45	56,03
BORÇLANMA SENETLERİ					
Eurobond					
XS1412393172	T.SINAI KALKINMA BANKASI A.Ş.	18/05/21	200.000,00	1.502.689,84	8,93
XS1079527211	T.IŞ BANKASI A.Ş.	25/06/21	200.000,00	1.500.140,76	8,92
XS1508914691	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	27/10/21	200.000,00	1.524.671,99	9,06
XS1571399754	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	24/02/22	300.000,00	2.263.204,44	13,46
	TOPLAM:		900.000,00	6.790.707,03	40,37
FUTURES					
RTY 2000 MAR2021 FUTURE(Uzun)			10,00	0,00	0,00
	TOPLAM:		10,00	0,00	0,00
TÜREV					
S&P 500 INDEX MAR2021 3500 P		19/03/21	-1,00	-17.689,92	-0,11
S&P 500 INDEX MAR2021 3800 C		19/03/21	1,00	64.863,04	0,39
	TOPLAM:		0,00	47.173,12	0,28
VOB Nakit Teminatı					
VOB Nakit Teminatı			113.013,97	113.013,97	0,67
VOB Nakit Teminatı			446.242,81	3.289.166,50	2,65
	TOPLAM:		559.256,78	3.402.180,47	3,32
PORTFÖY DEĞERİ:		1.802.616,78		16.820.566,07	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
----------	-------	-------

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

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	16.820.566,07	99,08 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1.285.642,11	7,57 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-1.129.731,65	-6,65 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	16.976.476,53	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	275,98	0,0016 %
Fon Yönetim Ücreti	12.277,64	0,0723 %
Kayda Alma Ücreti	219,75	0,0013 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	7.502,71	0,0442 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	164,00	0,0010 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	4.234,00	0,0249 %
Diğer Harcamalar	2.483,01	0,0146 %
BİST KYD Ücreti	560,00	0,0033 %
TOPLAM:	27.717,09	0,1632 %

VI-A-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
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

B-Geçen Ay İçinde Yatırım Fonlarına İlişkin Mevzuatta Meydana Gelen Değişme ve Hukuki İhtilaflarla İlgili Açıklamalar

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
USD	2.450.000,000	23.027,55	75.658.817,000	713.502,32

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

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

Portföy Tarihi	Bağlaşıcı Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örneklem Sayısı	Eldé Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
26.02.2021	27.02.2021	26.02.2021	Tarifsel_Benzetimi1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com

	Mutlak Risk			Görel Risk			2013. Yıl	
	FTD	RMD	RMD/FTD Limit	Kıtas RMD	Kıtas RMD/FTD	Görel RMD	Stres RMD	Stres RMD/FTD
KRS-A	16.976.476,53	6.640.547,01	39,12%	20,00%			1.995.953,32	11,76%
KRS-B	2.303.206,78	911.704,62	39,58%	20,00%			421.410,26	18,30%

KALDIRAÇ RAPORU

	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraç / İslam RMD
KRS-A	16.976.476,53		31.954.860,24	24.084.351,33	1.88	7,00	11.110.704,86
KRS-B	2.303.206,78		2.416.070,52	2.409.432,14	1.05	7,00	763.338,27

DUYARLILIK ANALİZİ

		Hisse -%10				Hisse -%20				USDTRY -10%			
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Bench. Değişim (%)
KRS-A	16.976.476,53	16.717.356,53	-259.120,00	-1,53	16.458.236,53	-518.240,00	-3,05	18.844.349,05	1.867.872,52	11,00	18.844.349,05	1.867.872,52	11,00
KRS-B	2.303.206,78	2.288.051,84	-35.154,94	-1,53	2.232.896,91	-70.309,87	-3,05	2.303.206,78	0,00	0,00	2.303.206,78	0,00	0,00

	US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps				TL Gov 300 bps			
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRV)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRV)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRV)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)		
KRS-A	16.976.476,53	16.976.372,44	-104,09	0,00	16.970.318,37	-6.158,16	-0,04	16.976.476,53	0,00	0,00		
KRS-B	2.303.206,78	2.303.192,66	-14,12	0,00	2.302.371,30	-835,48	-0,04	2.303.206,78	0,00	0,00		

		SP500 - %5				Lluidite Senaryo (KRC,KRT,KUB,KYA)				Lluidite Senaryo (KRF)			
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRV)	Port. Değişim (TRV)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRV)	Port. Değişim (TRV)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRV)	Port. Değişim (TRV)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRS-A	16.976.476,53	16.941.969,78	-34.506,75	-0,20		16.208.187,03	-768.289,50	-4,53		16.766.076,80	-210.399,73	-1,24	
KRS-B	2.303.206,78	2.298.525,23	-4.681,55	-0,20		2.249.638,89	-53.567,88	-2,33		2.274.664,75	-28.545,03	-1,24	

	FTD	Şok Sonrası Port. (TRV)	Port. Değişim (TRV)	Port. Değişim (%)	Likidite Senaryo (KPB)	Bench. Değişim (%)
KRS-A	16.976.476,53	16.545.291,98	-431.184,55	-2,54		-2,54
KRS-B	2.303.206,78	2.244.707,76	-58.499,02	-2,54		-2,54

Senaryo	Senaryo Tanımı
Hisse -%10:	Hisse senedi piyasası açığı, Yönlü 10% şok
Hisse -%20:	Hisse senedi piyasası açığı, Yönlü 20% şok
USDTRY 10%	USDTRY kuruna yönlü 10% şok
USD TRY 20%	USDTRY kuruna yönlü 20% şok
US Gov 10yr 100 bps:	US Hazine verim eğrisine yönlü 100 baz puan paralel şok (VKGS >= 10 yr)
US Gov 200 bps:	US Hazine verim eğrisine 200 baz puan yönlü paralel şok
TL Gov 300 bps:	TL Hazine verim eğrisine 300 baz puan yönlü paralel şok
UKLİDİT Senaryo (KRS)	Eşyanamalı olarak; Eşyanamalı: -%8, USD Fair +100 bps, USDTRY -2% (MOP), TL Fair +200 bps, EURUSD

KRS-A	Kare Portföy Serbest Fon (TRY) <i>Gösternin amaçladığı.</i> 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 Multiok - RMD