

KRS_Ekim 2018 Portföy Dağılım Raporu

1- FONU TANITICI BİLGİLER				
A. FONUN ADI:	Kare Portföy Birinci Değişken Fon			
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
D. FON TUTARI	0			
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	27.085.908,62			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	25.947.450,00			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	06/02/2018			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZDİR			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	1,043876			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1,013618			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	2,99%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	4,39%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	4,33%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi				
Varant				
Devlet Tahvili				
Özel Sektör Tahvili	29,64%			
Finansman Bonosu	8,80%			
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	2,64%			
Kıymetli Madenler				
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	13,88%			
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	43,88%			
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri	1,16%			
Vadeli Mevduat TL				
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	10,36%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0,00%			
Devlet Borçlanma Senetleri	7,43%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	861,907			
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. AYLIK TAKİP HATASI :				
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
N. AYLIK TAKİP FARKI :				
O. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI :				
P. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
R. GEÇEN AYKİ TAKİP FARKI :				
S. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN				
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	564.936,40			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	85.649,15			

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:				
TRFDFKT31912	1.000.000,00	1.041.605,10	3,83%	
TRFFBFBK21916	590.000,00	539.068,43	1,98%	
TRFTPCF11915	500.000,00	476.287,20	1,75%	
TRFULFK51911	500.000,00	537.351,20	1,98%	
TRFVERA31912	300.000,00	308.110,08	1,13%	
TOPLAM :	2.890.000,00	2.902.422,01	10,67%	
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:				
TRFULFK21914	500.000,00	524.538,10	1,93%	
TRSAEST91911	700.000,00	696.670,52	2,56%	
TRSAZEV21919	500.000,00	540.584,65	1,99%	
TRSCLEK21918	500.000,00	524.798,15	1,93%	
TRSHYTV22012	500.000,00	528.932,85	1,95%	
TRSHYTV62117	1.000.000,00	1.029.063,70	3,78%	
TRSHYTV92015	700.000,00	721.086,80	2,65%	
TRSMGTI72011	450.000,00	455.209,97	1,67%	
TRSMGTIE2015	800.000,00	805.579,36	2,96%	
TRSPLDG52014	1.500.000,00	1.569.521,40	5,77%	
TRsvera51913	700.000,00	735.788,90	2,71%	
TRSZOES51913	500.000,00	526.676,50	1,94%	
TOPLAM :	8.350.000,00	8.658.450,90	31,84%	
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:				
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:				
I) KİRA SERTİFİKALARI:				
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:				
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:				
NO0010710882	300.000,00	1.724.281,13	6,34%	
XS0847042024	200.000,00	907.670,33	3,34%	
XS0849728190	200.000,00	938.602,64	3,45%	
XS0882347072	200.000,00	1.002.160,68	3,69%	
XS1082151868	300.000,00	1.627.641,03	5,99%	
XS1117601796	200.000,00	1.044.441,07	3,84%	
XS1132450427	200.000,00	751.392,34	2,76%	
XS1386178237	400.000,00	1.512.395,36	5,56%	
XS1396282177	200.000,00	918.204,69	3,38%	
XS1571399754	200.000,00	1.011.221,55	3,72%	
US0925331086 - BLACKROCK	776	24.668,62	0,09%	
US0925331086 - BLACKROCK	8.500,00	270.210,45	0,99%	
TOPLAM :	2.409.276,00	11.732.889,89	43,15%	
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:				
M) KATILIM HESAPLARI:				
N) KATILMA BELGELERİ:				
O) VOB İŞLEMLERİ:				
F_USDTRY1218	-2.025,00	5,76	0,00%	
TOPLAM :	-2.025,00	5,76	0,00%	
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:				
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:				
TL	3.896.775,41	3.896.775,41	14,33%	
TOPLAM :	3.896.775,41	3.896.775,41	14,33%	

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:				
T) DİĞER:				
FON PORTFÖY DEĞERİ	17.546.051,41	27.190.538,21		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	27.190.538,21	100,39%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	111.335,16	0,41%		
C. ALACAKLAR (+) :	0	0,00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0,00%		
E. BORÇLAR (-) :	215.964,75	0,80%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	27.085.908,62			
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			
37001Fon Yönetim Ücreti	33.017,77			
37002Denetim Ücreti	576,29			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	38,8			
37006Saklama Giderleri	1.187,83			
370142BİST Endeks K. Öltücü Kullanım bedeli	327,36			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	825,84			
37023VOB İşlemi Komisyonu	4.508,24			
37045Fon Saklama Ücreti	1.781,21			
TOPLAM	42.263,34			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
BKCC Bds:%3	9.007,00			
7-İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal Değeri		
8- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal Değeri	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0

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

KARE PORTFÖY SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_EKİM 2018

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.10.2018

	Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
	31.10.2018	07.11.2016	31.10.2018	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	189.114.310,30	25.239.178,62	13,35%	20,00%					10.912.219,26	5,77%
KRS-B	34.396.302,41	1.326.202,27	3,86%	20,00%					2.387.928,23	6,94%

KALDIRAÇ RAPORU

31.10.2018

	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRS-A	189.114.310,30	23.215.123,50	23.215.123,50	0,12	7,00	0,12	-	1.847.489,07
KRS-B	34.396.302,41	5.162.715,67	2.901.244,02	0,15	7,00	0,08	-	274.046,37

DUYARLILIK ANALİZİ

31.10.2018

		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	189.114.310,30	189.052.610,30	-61.700,00	-0,03		188.990.910,30	-123.400,00	-0,07		208.540.316,27	19.426.005,97	10,27	
KRS-B	34.396.302,41	34.385.080,35	-11.222,06	-0,03		34.373.858,29	-22.444,12	-0,07		34.744.802,41	348.500,00	1,01	
		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	189.114.310,30	188.993.997,41	-120.312,89	-0,06		189.102.616,37	-11.693,93	-0,01		188.078.335,24	-1.035.975,06	-0,55	
KRS-B	34.396.302,41	34.374.419,78	-21.882,63	-0,06		34.394.175,51	-2.126,90	-0,01		34.207.878,22	-188.424,19	-0,55	
		Likidite Senaryo (KRC, 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	189.114.310,30	183.963.475,88	-5.150.834,42	-2,72		184.579.332,79	-4.534.977,51	-2,40		188.426.746,68	-687.563,62	-0,36	
KRS-B	34.396.302,41	34.092.639,27	-303.663,14	-0,88		34.192.190,50	-204.111,91	-0,59		34.271.247,64	-125.054,77	-0,36	

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