

KRS_Mayıs 2020 Portföy Dağılım Raporu

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	271.904.172,01		
F. TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	5.086.178.996,04		
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	05/03/2012 00:00:00		
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ		
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER			
A. AY SONU PAY FİYATI	0,053459	29/05/120 00:00:00	
B. ÖNCEKİ PAY FİYATI:	0,051829		
C. AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	3,14%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-0,40%		
E. YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI:	3,21%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ			
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:			
Hisse Senedi	0,57%		
Varant			
Devlet Tahvili			
Özel Sektör Tahvili	9,00%		
Finansman Bonosu	0,86%		
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			
Kıymetli Madenler			
ViOP İşlemleri			
ViOP Nakit Teminat	1,84%		
Yabancı Sabit Getirililer			
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	64,22%		
Opsiyon İşlemleri			
Yabancı Hisse Senetleri	23,51%		
Forward			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	36,07%		
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:			
Hisse Senedi	0,00%		
Devlet Borçlanma Senetleri	11,95%		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1.707,48		
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	483000	0,18%
HALKB	100000	532000	0,20%
MAVI	11000	497200	0,19%
TOPLAM :	171000	1512200	0,57%
B) VARANT:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFHYYTV62015	1500000	1485934,5	0,56%
TRFLDFK62013	750000	749093,025	0,28%
TOPLAM :	2250000	2235027,525	0,84%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRFDGOZ71915	232.362,00	233618,0328	0,09%
TRSAEST91911	500.000,00	536981,25	0,20%
TRSAEST91911	-500.000,00	-536981,25	-0,20%
XS0221762932	8.000.000,00	7919280	2,98%
XS1620560695	3.000.000,00	3160890	1,19%
XS1680052617	3.000.000,00	2919690	1,10%
XS1738510731	3.000.000,00	3065400	1,15%
XS1877869757	5.000.000,00	6135750	2,31%
TOPLAM :	22232362	23434628,03	8,83%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
NO0010710882	186.743,00	1231088,221	0,46%
NO0010710882	2.339.495,00	15422932,78	5,81%
NO0010823347	1.100.000,00	6485654,206	2,44%
NO0010843782	800.000,00	4702721,229	1,77%
NO0010852643	1.000.000,00	5777284,744	2,18%
US040114GW47	1.500.000,00	4218185,097	1,59%
US05616JAN37	1.000.000,00	3026076,718	1,14%
US09626FAL58	1.000.000,00	3171892,038	1,19%
US14314NAC56	1.000.000,00	2989350,336	1,13%
US60937GAD88	300.000,00	2129033,134	0,80%
US67590DAJ54	1.000.000,00	3498477,472	1,32%
US900123CM05	1.500.000,00	8027133,366	3,02%
USG13545AC52	1.000.000,00	4713923,116	1,78%
USG3333YAA85	1.000.000,00	6135690,624	2,31%
USG6868VAA01	1.000.000,00	4700704,344	1,77%
XS1003016018	800.000,00	5679329,555	2,14%
XS1079527211	700.000,00	4901207,223	1,85%
XS1188073081	900.000,00	6158973,379	2,32%
XS1261825977	1.083.333,00	7507544,737	2,83%
XS1303918939	500.000,00	3477559,106	1,31%
XS1386178237	600.000,00	3645846,338	1,37%
XS1396282177	650.000,00	4320593,104	1,63%
XS1584113184	500.000,00	3160478,923	1,19%
XS1613091500	400.000,00	2704478,986	1,02%
XS1655085485	800.000,00	3366071,71	1,27%

XS1711581337	550.000,00	3628716,445	1,37%
XS1747548532	1.000.000,00	6695171,742	2,52%
XS1750996206	800.000,00	5384537,312	2,03%
XS1881358979	2.000.000,00	13375080,57	5,04%
XS1939101579	3.000.000,00	19525216,45	7,35%
XS1958649854	200.000,00	1435476,874	0,54%
AAPL	800	1730759,71	0,65%
AGNC US	28.500,00	2503151,637	0,94%
AINV	13.173,00	885913,3096	0,33%
AINV	50.689,00	3408947,07	1,28%
AINV	15.000,00	1008783,09	0,38%
AINV	7.828,00	526450,2686	0,20%
ARCC US	371	37691,2842	0,01%
ARCC US	15.033,00	1527258,964	0,58%
ARCC US	13.000,00	1320718,854	0,50%
ARCC US	6.000,00	609562,548	0,23%
ARCC US	18.000,00	1828687,644	0,69%
ARCC US	6.000,00	609562,548	0,23%
ARCC US	6.000,00	609562,548	0,23%
ARCC US	13.000,00	1320718,854	0,50%
ARES	500.000,00	1303439,057	0,49%
ARI US	5.500,00	312174,247	0,12%
ARI US	8.000,00	454071,632	0,17%
ARI US	13.000,00	737866,402	0,28%
ARI US	8.500,00	482451,109	0,18%
ATH USD	5.230,00	1024896,364	0,39%
ATH USD	5.400,00	1058210,395	0,40%
BABA US	1.190,00	1606764,904	0,61%
BALLYROCK	500.000,00	899622,6071	0,34%
BRK/B US	2.300,00	2877644,899	1,08%
DIS US	1.720,00	1358317,402	0,51%
DIS US	2.000,00	1579438,84	0,59%
DRYD	750.000,00	2113590,89	0,80%
FACEBOOK	1.135,00	1732959,205	0,65%
FACEBOOK	1.150,00	1755861,75	0,66%
FACEBOOK	1.250,00	1908545,38	0,72%
GSBD	4.963,00	577930,6398	0,22%
GSBD	5.000,00	582239,21	0,22%
GSBD	10.000,00	1164478,42	0,44%
GSBD	6.000,00	698687,052	0,26%
GSBD	4.800,00	558949,6416	0,21%
GSBD	735	85589,1639	0,03%
GSBD	705	82095,7286	0,03%
GSBD	1.057,00	123085,369	0,05%
JPM	800	534365,4512	0,20%
JPM	2.000,00	1335913,628	0,50%
KKR	750.000,00	2623203,979	0,99%
MSFT US	1.500,00	1848924,63	0,70%
NLY US	55.000,00	2334748,57	0,88%
NVDA US	180	420070,77	0,16%
NVDA US	920	2147028,38	0,81%
OXLC US	20.986,00	451862,3255	0,17%
OXLC US	5.000,00	107658,04	0,04%
OXLC US	20.000,00	430632,16	0,16%
OXLC US	25.000,00	538290,2	0,20%
OXLC US	1.000,00	21531,608	0,01%
OXLC US	20.000,00	430632,16	0,16%
OXLC US	639	13758,6975	0,01%
OXLC US	200	4306,3216	0,00%
OXLC US	2.654,00	57144,8876	0,02%
TSLX US	2.928,00	367493,8539	0,14%
TSLX US	10.000,00	1255101,96	0,47%
TSLX US	15.000,00	1882652,94	0,71%
TSLX US	490	61499,996	0,02%
TSLX US	11.000,00	1380612,156	0,52%
TSLX US	200	25102,0392	0,01%
VZ US	4.300,00	1618202,548	0,61%
TOPLAM :	33.192.397,00	234093845,8	88,18%

L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) VOB İŞLEMLERİ:			
F_EURTRY0620	-300	7,6337	0,00%
F_USDTRY0620	2050	6,8707	0,00%
F_USDTRY0820	700	6,9734	0,00%
F_USDTRY1220	1000	7,1502	0,00%
RUT Dec 2021 1150 P	-1	104	0,00%
RUT Dec 2021 1550 C	1	103	0,00%
SPX Dec 2021 2500 P	-1	185,5	0,00%
SPX Dec 2021 3300 C	1	173,9	0,00%
TOPLAM :	1	595,028	0,00%
O) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
P) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	4200329,82	4200329,82	1,58%
TOPLAM :	4200329,82	4200329,82	1,58%
R) ÖDÜNÇ TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
S) REPO TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
T) FORWARD İŞLEMLERİ:			
U) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
V) DİĞER:			
FON PORTFÖY DEĞERİ	62.046.088,82	265476031,2	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	265.476.031,20	97,64%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	13.579.677,82	4,99%	
C. ALACAKLAR (+) :	775.284,18	0,29%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0,00%	
E. BORÇLAR (-) :	7.926.821,19	2,92%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	271.904.172,01		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	223.559,72		
37002Denetim Ücreti	2.756,32		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	35.532,31		
37006Saklama Giderleri	22.469,27		
370142BİST Endeks K. Öltüçü Kullanım bedeli	273,56		
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	6.310,84		
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	4.140,19		
37023VOB İşlemi Komisyonu	1.906,22		
37034YurtDışı Türev İşlem Komisyonu	450,8		
37045Fon Saklama Ücreti	16.080,93		
37098Küsürat farkları	1,83		
TOPLAM	313.481,99		
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI			
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM.			
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA			
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR			
Açıklama	Nominal		
OXLC US Bds:%3 Tem:%0	92.825,00		
TSLX US Bds:%2	39.025,98		
AGNC US Tem:%10	28.500,00		
AAPL Tem:%66	800		

7- İTFALAR			
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal	
TRSPLDG52014	14/05/2020 00:00:00	5.000.000,00	
8- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal
Verilen Ödünçler			
Alınan Ödünçler			
9- REPO İLE SAĞLANAN BORÇ TUTARI:			
	Nom. Değ.(1000 TL)	Rayiç Değ.(1000 TL)	
10-KREDİLİ MENKUL KIYMET ALIM İŞLEMLERİ:			
11- 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_MAYIS 2020

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

29.05.2020									
Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
29.05.2020	25.05.2018	29.05.2020	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	271.904.172,00	50.543.367,17	18,59%	20,00%				18.344.429,79	6,75%
KRS-B	39.904.924,13	4.097.860,24	10,27%	20,00%				2.661.771,66	6,67%

KALDIRAÇ RAPORU

29.05.2020									
	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD	
KRS-A	271.904.172,00	27.824.850,00	27.824.850,00	0,10	7,00	0,10	-	3.046.190,43	
KRS-B	39.904.924,13	4.502.586,66	3.213.944,52	0,11	7,00	0,08	-	396.576,96	

DUYARLILIK ANALİZİ

29.05.2020													
		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	271.904.172,00	271.802.672,00	-101.500,00	-0,04		271.701.172,00	-203.000,00	-0,07		304.478.436,36	32.574.264,36	11,98	
KRS-B	39.904.924,13	39.890.027,89	-14.896,24	-0,04		39.875.131,65	-29.792,48	-0,07		40.279.924,13	375.000,00	0,94	
		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	271.904.172,00	271.725.473,73	-178.698,27	-0,07		269.568.812,73	-2.335.359,27	-0,86		263.328.992,61	-8.575.179,39	-3,15	
KRS-B	39.904.924,13	39.878.698,20	-26.225,93	-0,07		39.562.184,50	-342.739,63	-0,86		38.646.422,36	-1.258.501,77	-3,15	
		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	271.904.172,00	256.597.337,36	-15.306.834,64	-5,63		260.810.082,64	-11.094.089,36	-4,08		267.199.072,79	-4.705.099,21	-1,73	
KRS-B	39.904.924,13	38.514.434,19	-1.390.489,94	-3,48		39.138.564,65	-766.359,48	-1,92		39.214.399,13	-690.525,00	-1,73	

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