

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon
Mart-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-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	19.007.324,23
E-) Katılma Payı Sayısı	:	257.082.076,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	05 Mart 2012
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	0,073935
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	0.008880
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	0,065806
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	0.008928
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	12,35
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	-0.54
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	9,57
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	41,85
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	36,83
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	-0,91
h-)Opsiyon	:	0,38
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,00
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	21,85
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	0,00
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
G-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
H-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	177,16

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	6.111,060000
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (USD)	:	14.526,800000

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ																			
Hisse Yabancı																			
MDAXEX GY	EUR				DE0005933923			640,00	266,342047	30/03/21					267,400000	1.671.793,36	19,01	9,74	8,80
GRUP TOPLAMI								640,00								1.671.793,36	19,01	9,74	8,80
Hisse Türk																			
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş. GARANTİ BANKASI			TRAAKBNK91N6			85.000,00	6,807647	17/02/21					4,690000	398.650,00	4,53	2,32	2,10
GARAN	TL	TJŞ BANKASI			TRAGARAN91N1			60.000,00	10,007500	17/02/21					6,690000	401.400,00	4,56	2,34	2,11
ISCTR	TL	TJŞ BANKASI A.Ş.			TRISCTR91N2			85.000,00	6,679412	17/02/21					4,820000	409.700,00	4,66	2,39	2,16
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALA RI A.Ş.			TRASISEW91Q3			70.000,00	7,745714	17/02/21					7,280000	509.600,00	5,79	2,97	2,68
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			TRATCELL91M1			35.000,00	16,711714	17/02/21					14,970000	523.950,00	5,96	3,05	2,76
GRUP TOPLAMI								335.000,00								2.243.300,00	25,50	13,07	11,81
Hisse Yabancı																			
EEM	USD	ISHARES, INC			US4642872349			7.250,00	55,753637	18/02/21					53,080000	3.204.017,61	36,43	18,67	16,86

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

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)	
RSP	USD	INVESCO S&P 500 EQUAL WEIGHT			US46137V3574			1,100,00	137,119627	01/03/21					183,040000	1,676,349,88	19,06	9,77	8,82	
GRUP TOPLAMI								8.350,00									4.880.367,49	55,49	28,44	25,68
GRUP TOPLAMI								343.990,00									8.795.460,85	100,00	51,25	46,29
BORÇLANMA SENETLERİ																				
Eurobond Türk																				
XS1412393172	USD	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	18/05/21	47	XS1412393172	2,35	2	200,000,00	101,835200	17/02/21	0,000000				101,983370	1,698,186,28	28,65	9,90	8,93	
XS1079527211	USD	T.İ.Ş. BANKASI A.Ş.	25/06/21	85	XS1079527211	2,48	2	200,000,00	101,555000	10/02/21	0,000000				101,701068	1,693,485,51	28,57	9,87	8,91	
XS1571399754	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	24/02/22	329	XS1571399754	3,70	2	300,000,00	104,699400	08/02/21	0,000000				101,523370	2,535,789,82	42,78	14,78	13,34	
GRUP TOPLAMI								700.000,00									5.927.461,61	100,00	34,55	31,18
GRUP TOPLAMI								700.000,00									5.927.461,61	100,00	34,55	31,18
TPP BORÇLANMA																				
TPP BORÇLANMA																				
TPP			01/04/21	0		18,70		-492,252,07	18,700000	31/03/21				-492,252,07	18,700000	-492,252,07	22,50	-2,87	-2,59	
TPP			01/04/21	0		18,60		-1,695,863,75	18,600000	31/03/21				-1,695,863,75	18,600000	-1,695,863,75	77,50	-9,88	-8,92	
GRUP TOPLAMI								-2.188.115,82									-2.188.115,82	100,00	-12,75	-11,51
GRUP TOPLAMI								-2.188.115,82									-2.188.115,82	100,00	-12,75	-11,51
TÜREV																				
Futures																				
Uzun																				
F_USDTRY0421	TL				F_USDTRY0421			290,00	8,507400	26/03/21					8,392400	2,433,796,00	0,00	0,00	0,00	
RTY 2000 JUN2021 FUTURE	TL				RTY 2000			10,00	2,320,000000	18/03/21					2,320,000000	1,160,000,00	0,00	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								300,00									3.593.796,00	0,00	0,00	0,00
Option																				
Call Alım																				
S&P 500 INDEX DEC2021 4000 C	USD		17/12/21		DEC2021 4000 C		0	1,00	231,000000	18/03/21					220,700000	183,750,41	233,05	1,07	0,97	
Put Satım																				
S&P 500 INDEX DEC2021 3500 P	USD		17/12/21		DEC2021 3500 P		0	-1,00	159,500000	18/03/21					126,000000	-104,905,08	-133,05	-0,61	-0,55	
GRUP TOPLAMI								0,00									78.845,33	100,00	0,46	0,42
GRUP TOPLAMI								300,00									3.672.641,33	100,00	0,46	0,42
VIOP Nakit Teminatı																				
VIOP Nakit Teminatı								643,120,60									643,120,60	100,00	3,75	
GRUP TOPLAMI								643,120,60									643,120,60	100,00	3,75	
GRUP TOPLAMI								643,120,60									643,120,60	100,00	3,75	
VIOP USD Nakit Teminatı																				
VIOP USD Nakit Teminatı								468,664,26									3,902,004,90	100,00	2,73	
GRUP TOPLAMI								468,664,26									3.902.004,90	100,00	2,73	
GRUP TOPLAMI								468,664,26									3.902.004,90	100,00	2,73	
DİĞER																				
Döviz																				
EUR	EUR	EU			EUR			171.471,09	9,787286	31/03/21					9,768800	1,675,066,78	0,00	0,00	8,81	
USD	USD	FED			USD			490,126,50	7,452013	31/03/21					8,325800	4,080,695,21	0,00	0,00	21,47	
GRUP TOPLAMI								661.597,59									5.755.761,99	0,00	0,00	30,28
GRUP TOPLAMI								661.597,59									5.755.761,99	0,00	0,00	30,28
FON PORTFÖY DEĞERİ																17.158.777,47	79,99			

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	17.158.777,47	90,27 %
B-)HAZİR DEĞERLER	1.869.246,34	9,83 %
C-)ALACAKLAR	4.736,46	0,02 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-25.436,04	-0,13 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	19.007.324,23	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	426,98	0,0022 %
Fon Yönetim Ücreti	16.741,75	0,0881 %

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

V-AY İÇİNDE YAPILAN GIDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Kayda Alma Ücreti	617,62	0,0032 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması	9.415,04	0,0495 %
Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler		
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	64,10	0,0003 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	3.410,00	0,0179 %
Diğer Harcamalar	5.827,25	0,0307 %
BİST KYD Ücreti	620,00	0,0033 %
Kambiyo Vergi Tutarı	3.347,50	0,0176 %
	40.470,24	0,2128 %

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

Sirketin Unvanı	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
AKBNK	Temmettö	30/03/21	10.234,00	10.234,00

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

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

KARE PORTFÖY SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RISK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_MART 2021

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örnekleme Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yatılım Risktürü	Mail Adresi
31.03.2021	01.04.2019	31.03.2021	Tarihsel Benzetim1	0.99	EWMA	500	20		market@riskturk.com

FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kıtas RMD	Kıtas RMD/FTD	Görell Risk	Görell RMD	Görell RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD	2013 Yaz
KRS-A	19.007.324,23	8.052.030,11	42,36%	20,00%					2.632.696,58	13,85%	
KRS-B	2.282.942,69	989.764,47	43,35%	20,00%					400.023,50	17,52%	

KALDIRAÇ RAPORU

FTD	Kaldıraç	Açık pozisyon	Kaldıraç / FTD	Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRS-A	19.007.324,23	40.495.074,62	213	7,00	1,45	-	12.749.727,74
KRS-B	2.282.942,69	2.789.979,04	1,22	7,00	1,16	-	787.654,30

DUYARILIK ANALİZİ

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	19.007.324,23	18.782.994,23	-224.330,00	-1,18	18.558.664,23	-448.660,00	-2,36	-2,36	21.147.471,73	2.140.147,50	11,26	11,26
KRS-B	2.282.942,69	2.255.998,73	-26.943,96	-1,18	2.229.054,77	-53.887,91	-2,36	-2,36	2.311.942,69	29.000,00	1,27	1,27

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	19.007.324,23	19.008.012,07	687,84	0,00	19.022.923,18	15.598,95	0,08	0,08	19.007.503,96	179,73	0,00	0,00
KRS-B	2.282.942,69	2.283.025,30	82,62	0,00	2.284.816,26	1.873,57	0,08	0,08	2.282.964,27	21,59	0,00	0,00

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	19.007.324,23	18.940.939,39	-66.384,84	-0,35	18.258.326,33	-748.997,90	-3,94	-3,94	18.835.530,47	-171.793,76	-0,90	-0,90
KRS-B	2.282.942,69	2.274.969,30	-7.973,39	-0,35	2.238.629,10	-44.313,59	-1,94	-1,94	2.262.308,78	-20.633,90	-0,90	-0,90

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	19.007.324,23	18.609.724,29	-397.599,94	-2,09								
KRS-B	2.282.942,69	2.235.187,52	-47.755,16	-2,09								

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) Eyzamanlı 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