

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon
Haziran-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-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	31.898.169,73
E-) Katılma Payı Sayısı	:	400.049.687,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	05 Mart 2012
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	0,079736
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	0.009186
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	0,076903
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	0.009048
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,68
Aylk Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	1.53
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	18,17
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	43,93
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	78,81
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	9,81
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	-6,40
h-)Opsiyon	:	1,31
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,00
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	16,47
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	:	0,01
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	:	234,76
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	408.719,920000

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)	:	5.044,540000

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 SÖZLEŞM E NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)				
HİSSE SENETLERİ																							
Hisse Yabancı																							
MDAXEX GY	EUR	ISHARES MDAX UCITS ETF DE			DE0005933923			640,00	266,342047	30/03/21					285,700000	1.887.887,32	8,49	6,54	5,92				
GRUP TOPLAMI								640,00												1.887.887,32	8,49	6,54	5,92
Hisse Türk																							
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			TRAKCHOL91Q8			16.000,00	18,840000	11/05/21					18,330000	293.280,00	1,32	1,02	0,92				
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALA RI A.Ş.			TRASISEW91Q3			70.000,00	7,745714	17/02/21					7,640000	534.800,00	2,40	1,85	1,68				
GRUP TOPLAMI								86.000,00												828.080,00	3,72	2,87	2,60
Hisse Yabancı																							
AAPL US	USD	APPLE INC			US0378331005			450,00	130,882867	18/06/21					136,779000	534.277,24	2,40	1,85	1,67				
ADBE US	USD	ADOBE INC			US00724F1012			130,00	580,135231	29/06/21					589,540000	665.259,93	2,99	2,31	2,09				
ADI US	USD	ANALOG DEVICES INC			US0326541051			375,00	161,949547	29/04/21					171,420000	557.991,38	2,51	1,93	1,75				
AMAT US	USD	APPLIED MATERIAL			US0382221051			425,00	141,498400	29/04/21					141,270000	521.163,04	2,34	1,81	1,63				

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon																			
Haziran-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)
AMZN US	USD	S INC AMAZON.COM INC			US0231351067			19,00	3.285,094211	29/04/21					3.467,510000	571.881,51	2,57	1,98	1,79
ANET US	USD	ARISTA NETWORKS INC			US0404131064			138,00	317,473841	24/06/21					359,970000	431.201,37	1,94	1,49	1,35
BABA US	USD	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR			US01609W1027			250,00	240,344320	29/04/21					226,705000	491.966,85	2,21	1,71	1,54
DHI US	USD	DR HORTON INC			US23331A1097			620,00	97,082952	29/04/21					90,285000	485.894,55	2,18	1,68	1,52
DIS US	USD	WALT DISNEY CO/THE			US2546871060			320,00	188,237969	29/04/21					174,320000	484.207,97	2,18	1,68	1,52
ENTG US	USD	ENTEGRIS INC			US29362U1043			415,00	116,745108	24/06/21					121,900000	439.123,36	1,97	1,52	1,38
FB US	USD	FACEBOOK INC-CLASS A			US30303M1027			220,00	342,256864	29/06/21					350,140000	668.650,45	3,00	2,32	2,10
FND US	USD	FLOOR & DECOR HOLDINGS INC-A			US3397501012			545,00	113,238532	29/04/21					106,500000	503.826,31	2,26	1,75	1,58
FTNT US	USD	FORTINET INC			US34959E1091			195,00	206,043949	24/06/21					241,070000	408.049,18	1,83	1,41	1,28
GAIA US	USD	GAIA INC			US36269P1049			5.000,00	10,927084	27/05/21					10,820000	469.604,23	2,11	1,63	1,47
GOOGL US	USD	ALPHABET INC-CL A			US02079K3059			30,00	2.447,490667	29/06/21					2.432,640000	633.481,35	2,85	2,19	1,99
GRMN US	USD	GARMIN LTD			CH0114405324			425,00	140,955176	29/04/21					144,070000	531.492,60	2,39	1,84	1,67
IBP US	USD	INSTALLED BUILDING PRODUCTS			US45780R1014			467,00	129,739700	29/04/21					120,820000	489.768,05	2,20	1,70	1,54
IIVI US	USD	II-VI INC			US9021041085			750,00	67,704413	24/06/21					72,340000	470.949,68	2,12	1,63	1,48
IRBT US	USD	IROBOT CORP			US4627261005			500,00	98,259900	11/05/21					93,850000	407.323,08	1,83	1,41	1,28
JBT US	USD	JOHN BEAN TECHNOLOGIES CORP			US4778391049			435,00	141,048552	29/04/21					139,415000	526.421,35	2,37	1,82	1,65
JPM US	USD	JPMORGAN CHASE & CO			US46625H1005			350,00	154,448886	29/06/21					155,530000	472.516,47	2,12	1,64	1,48
LRCX US	USD	LAM RESEARCH CORP			US5128071082			92,00	652,622717	29/04/21					645,390000	515.400,45	2,32	1,79	1,62
MBUU US	USD	MALIBU BOATS INC - A			US56117J1007			710,00	84,454577	29/04/21					72,320000	445.709,10	2,00	1,55	1,40
MED US	USD	MEDIFAST INC			US58470H1014			255,00	225,433216	29/04/21					283,415000	627.332,44	2,82	2,17	1,97
MKSI US	USD	MKS INSTRUMENTS INC			US55306N1046			320,00	187,595781	29/04/21					177,140000	492.041,07	2,21	1,70	1,54
MSFT US	USD	MICROSOFT CORP			US5949181045			280,00	266,256393	29/06/21					270,660000	657.834,80	2,96	2,28	2,06
MU US	USD	MICRON TECHNOLOGY INC			US5951121038			855,00	92,782444	16/04/21					83,590000	620.376,27	2,79	2,15	1,94
NVDA US	USD	NVIDIA CORP			US67066G1040			98,00	631,982041	29/04/21					800,070000	680.595,07	3,06	2,36	2,13
PHM US	USD	PULTEGROUP INC			US7458671010			1.110,00	55,074730	29/04/21					54,770000	527.716,23	2,37	1,83	1,65
ROKU US	USD	ROKU INC			US77543R1023			170,00	340,216588	18/06/21					440,500000	650.024,27	2,92	2,25	2,04
RSP	USD	INVESCO S&P 500 EQUAL WEIGHT			US46137V3574			1.100,00	137,119627	01/03/21					150,610000	1.438.073,98	6,46	4,98	4,51
SSTK US	USD	SHUTTERS TOCK INC			US8256901005			600,00	89,072017	27/05/21					99,190000	516.599,37	2,32	1,79	1,62
TER US	USD	TERADYNE INC			US8807701029			460,00	132,588978	29/04/21					133,460000	532.897,51	2,39	1,85	1,67
VRTS US	USD	VIRTUS INVESTMENT			US92828Q1094			235,00	259,905702	29/04/21					270,900000	552.600,92	2,48	1,92	1,73
VRTX US	USD	PARTNERS VERTEX PHARMACEUTICALS INC			US92532F1003			300,00	190,526767	18/06/21					198,110000	515.896,27	2,32	1,79	1,62
GRUP TOPLAMI								18.644,00								19.538.147,70	87,79	67,71	61,26
GRUP TOPLAMI								105.284,00								22.254.115,02	100,00	77,12	69,78
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Eurobond Türk																			
XS1571399754	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	24/02/22	238	XS1571399754	3,70	2	300.000,00	104,699400	08/02/21	0,000000				104,220932	2.714.006,86	100,00	9,42	8,51
GRUP TOPLAMI								300.000,00								2.714.006,86	100,00	9,42	8,51
GRUP TOPLAMI								300.000,00								2.714.006,86	100,00	9,42	8,51
TPP BORÇLANMA																			
TPP BORÇLANMA																			
TPP			01/07/21	0		19,20		-1.133.595,99	19,200000	30/06/21				-1.133.595,99	19,200000	-1.133.595,99	100,00	-3,93	-3,55
GRUP TOPLAMI								-1.133.595,99								-1.133.595,99	100,00	-3,93	-3,55
GRUP TOPLAMI								-1.133.595,99								-1.133.595,99	100,00	-3,93	-3,55
TÜREV																			
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					382,760000	332.247,16	67,49	1,15	1,04
S&P 500 INDEX DEC2021 4200 C	USD		17/12/21		DEC2021 4200 C		0	1,00	221,650000	21/05/21					230,290000	199.898,63	40,60	0,69	0,63
S&P 500 INDEX DEC2021 4300 C	USD		17/12/21		DEC2021 4300 C		0	1,00	154,500000	25/06/21					170,750000	148.216,12	30,11	0,51	0,46
Put Satım																			
S&P 500 INDEX DEC2021 3500 P	USD		17/12/21		DEC2021 3500 P		0	-1,00	159,500000	18/03/21					45,920000	-39.859,94	-8,10	-0,14	-0,12
S&P 500 INDEX DEC2021 3800 P	USD		17/12/21		DEC2021 3800 P		0	-1,00	131,150000	21/05/21					77,800000	-67.532,73	-13,72	-0,23	-0,21
S&P 500 INDEX DEC2021 3900 P	USD		17/12/21		DEC2021 3900 P		0	-1,00	97,100000	25/06/21					92,900000	-80.639,99	-16,38	-0,28	-0,25
GRUP TOPLAMI								0,00								492.329,25	100,00	1,70	1,55
GRUP TOPLAMI								0,00								492.329,25	100,00	1,70	1,55
VIOP Nakit Teminatı																			

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon																			
Haziran-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)
VIOP Nakit Teminatı								484.006,92								484.006,92	100,00	1,68	
GRUP TOPLAMI								484.006,92								484.006,92	100,00	1,68	
GRUP TOPLAMI								484.006,92								484.006,92	100,00	1,68	
VIOP USD Nakit Teminatı																			
VIOP USD Nakit Teminatı								465.930,44								4.044.416,00	100,00	1,61	
GRUP TOPLAMI								465.930,44								4.044.416,00	100,00	1,61	
GRUP TOPLAMI								465.930,44								4.044.416,00	100,00	1,61	
DİĞER																			
Döviz																			
EUR	EUR	EU			EUR			471,09	9,787090	30/06/21					10,324900	4.863,96	0,00	0,00	0,02
USD	USD	FED			USD			829.007,74	8,599610	30/06/21					8,680300	7.196.035,89	0,00	0,00	22,56
GRUP TOPLAMI								829.478,83								7.200.899,85	0,00	0,00	22,58
GRUP TOPLAMI								829.478,83								7.200.899,85	0,00	0,00	22,58
FON PORTFÖY DEĞERİ																28.855.278,06		87,60	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	28.855.278,06	90,46 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3.157.733,22	9,90 %
C-)ALACAKLAR	9.721,68	0,03 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-124.563,23	-0,39 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	31.898.169,73	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	2.093,67	0,0066 %
Fon Yönetim Ücreti	60.362,83	0,1892 %
Kayda Alma Ücreti	711,90	0,0022 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	13.689,25	0,0429 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	64,10	0,0002 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	3.639,76	0,0114 %
Diğer Harcamalar	1.548,82	0,0049 %
BİST KYD Ücreti	360,00	0,0011 %
Kambiyo Vergi Tutari	1.849,60	0,0058 %
	84.319,93	0,2643 %

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
SISE	Temmettü	02/06/21	11.425,90	11.425,90
VESBE	Temmettü	02/06/21	8.421,05	8.421,05

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

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

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

30.06.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örnekleme Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
30.06.2021	02.07.2019	30.06.2021	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	31.898.169,73	5.794.002,86	18,16%	20,00%				2.392.634,85	7,50%
KRS-B	3.674.777,34	656.398,39	17,86%	20,00%				268.247,84	7,30%

KALDIRAÇ RAPORU

30.06.2021

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRS-A	31.898.169,73	9.646,07	8.923,52	0,00	7,00	0,00	13.545,68
KRS-B	3.674.777,34	9.646,07	8.923,52	0,00	7,00	0,00	1.560,20

DUYARLILIK ANALİZİ

30.06.2021

		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 (%)	Bench. Değişim (%)
KRS-A	31.898.169,73	31.815.361,73	-82.808,00	-0,26	31.732.553,73	-165.616,00	-0,52	-0,52	35.246.154,51	3.347.984,78	10,50		
KRS-B	3.674.777,34	3.665.237,58	-9.539,76	-0,26	3.655.697,81	-19.079,52	-0,52	-0,52	3.674.777,34	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 (%)	Bench. Değişim (%)
KRS-A	31.898.169,73	31.898.185,04	15,31	0,00	31.898.831,59	661,86	0,00	0,00	31.898.262,86	93,13	0,00		
KRS-B	3.674.777,34	3.674.779,10	1,76	0,00	3.674.853,59	76,25	0,00	0,00	3.674.788,07	10,73	0,00		

		SP500 -%5				Likidite Senaryo				Likidite Senaryo			
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 (%)	Bench. Değişim (%)
KRS-A	31.898.169,73	31.895.166,64	-3.003,09	-0,01	31.105.133,56	-793.036,17	-2,49	-2,49	31.832.312,99	-65.856,74	-0,21		
KRS-B	3.674.777,34	3.674.431,37	-345,97	-0,01	3.660.558,25	-14.219,09	-0,39	-0,39	3.667.190,42	-7.586,92	-0,21		

		Likidite Senaryo			
FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRS-A	31.898.169,73	31.771.424,01	-126.745,72	-0,40	-0,40
KRS-B	3.674.777,34	3.660.175,80	-14.601,54	-0,40	-0,40

		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) <i>Karşılaştırma Ölçütü : Yok (Eşik değer = BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD)</i>
		KRS-B	Kare Portföy Serbest Fon (USD) <i>Karşılaştırma Ölçütü : Yok (Eşik değer = BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD)</i>
		KRS-B	RMD Yöntemi <i>Mutlak RMD</i>