

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon Eylül-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	:	59.003.951,51
E-) Katılma Payı Sayısı	:	739.271.169,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	05 Mart 2012
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	0,079814
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	0.008990
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	0,078708
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	0.009478
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	1,41
Aylk Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	-5.15
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	18,28
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	18,28

F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	86,73
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	5,27
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	-3,08
h-)Opsiyon	:	1,42
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,00
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	9,66
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	0,00
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00

G-)Yıllık 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 : 146,00

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	118.032,280000

I-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (TL)	:	0,00
F-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıktıları (USD)	:	13.353,050000

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

[illegible]

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon																			
Eylül-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)
AAPL US	USD	APPLE INC			US0378331005			1.985,00	143,360217	20/08/21					143,090000	2.521.792,76	5,83	5,09	4,27
ADBE US	USD	ADOBE INC			US00724F1012			250,00	593,862200	16/07/21					579,780000	1.286.894,18	2,98	2,60	2,18
ADI US	USD	ANALOG DEVICES INC			US0326541051			895,00	166,052547	16/07/21					169,960000	1.350.545,92	3,13	2,72	2,29
AMAT US	USD	APPLIED MATERIALS INC			US0382221051			1.100,00	139,486136	16/07/21					129,700000	1.266.695,60	2,93	2,56	2,15
AMZN US	USD	AMAZON.COM INC			US0231351067			54,00	3.558,958333	16/07/21					3.310,000000	1.586.943,09	3,68	3,20	2,69
ANET US	USD	ARISTA NETWORKS INC			US0404131064			198,00	334,198333	16/07/21					348,540000	612.713,45	1,42	1,24	1,04
DHI US	USD	DR HORTON INC			US23331A1097			620,00	97,082952	29/04/21					86,280000	474.942,93	1,10	0,96	0,80
DIS US	USD	WALT DISNEY CO/THE			US2546871060			845,00	184,959716	16/07/21					172,560000	1.294.602,50	3,00	2,61	2,19
ENTG US	USD	ENTEGRIS INC			US29362U1043			415,00	116,745108	24/06/21					127,720000	470.594,24	1,09	0,95	0,80
FB US	USD	FACEBOOK INC-CLASS A			US30303M1027			570,00	349,286491	16/07/21					340,865000	1.725.030,84	4,00	3,48	2,92
FND US	USD	FLOOR & DECOR HOLDINGS INC-A			US3397501012			545,00	113,238532	29/04/21					125,145000	605.549,44	1,40	1,22	1,03
GAIA US	USD	GAIA INC			US36269P1049			5.000,00	10,927084	27/05/21					9,650000	428.387,63	0,99	0,86	0,73
GOOGL US	USD	ALPHABET INC-CL A			US02079K3059			80,00	2.508,299375	16/07/21					2.697,750000	1.916.157,87	4,44	3,86	3,25
IBP US	USD	INSTALLED BUILDING PRODUCTS			US45780R1014			467,00	129,739700	29/04/21					111,075000	460.545,77	1,07	0,93	0,78
IIVI US	USD	II-VI INC			US9021041085			2.075,00	71,164246	16/07/21					60,320000	1.111.268,57	2,57	2,24	1,88
IRBT US	USD	IROBOT CORP			US4627261005			500,00	98,259900	11/05/21					80,318300	356.553,01	0,83	0,72	0,60
JPM US	USD	JPMORGAN CHASE & CO			US46625H1005			970,00	154,931268	16/07/21					166,024000	1.429.822,76	3,31	2,88	2,42
LRCX US	USD	LAM RESEARCH CORP			US5128071082			242,00	638,828223	16/07/21					570,620000	1.226.032,42	2,84	2,47	2,08
MBUU US	USD	MALIBU BOATS INC - A			US56117J1007			710,00	84,454577	29/04/21					70,220000	442.648,27	1,03	0,89	0,75
MED US	USD	MEDIFAST INC			US58470H1014			255,00	225,433216	29/04/21					195,670000	443.000,30	1,03	0,89	0,75
MKSI US	USD	MKS INSTRUMENTS INC			US55306N1046			450,00	180,809800	16/07/21					152,770000	610.365,80	1,41	1,23	1,03
MSFT US	USD	MICROSOFT CORP			US5949181045			720,00	275,363903	16/07/21					286,090000	1.828.836,05	4,24	3,69	3,10
MU US	USD	MICRON TECHNOLOGY INC			US5951121038			1.905,00	85,591286	16/07/21					71,260000	1.205.259,04	2,79	2,43	2,04
NFLX US	USD	NETFLIX INC			US64110L1061			400,00	523,119975	20/08/21					610,780000	2.169.124,09	5,02	4,38	3,68
NVDA US	USD	NVIDIA CORP			US67066G1040			992,00	186,747218	26/07/21					208,860000	1.839.528,60	4,26	3,71	3,12
PATH US	USD	UIPATH INC - CLASS A			US90364P1057			3.100,00	63,645245	26/08/21					52,549900	1.446.349,29	3,35	2,92	2,45
PHM US	USD	PULTEGROUP INC			US7458671010			1.110,00	55,074730	29/04/21					47,830000	471.371,11	1,09	0,95	0,80
ROKU US	USD	ROKU INC			US77543R1023			290,00	376,493241	08/07/21					304,638000	784.371,26	1,82	1,58	1,33
RSP	USD	INVESCO S&P 500 EQUAL WEIGHT			US46137V3574			1.100,00	137,119627	01/03/21					152,615000	1.490.491,51	3,45	3,01	2,53
SEDG US	USD	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC			US83417M1045			700,00	286,503143	26/08/21					266,940000	1.659.018,75	3,84	3,35	2,81
SSTK US	USD	SHUTTERS TOCK INC			US8256901005			1.485,00	96,746579	16/07/21					114,820000	1.513.852,61	3,51	3,05	2,57
TER US	USD	TERADYNE INC			US8807701029			460,00	132,588978	29/04/21					110,570000	451.580,04	1,05	0,91	0,77
TTD US	USD	TRADE DESK INC/THE - CLASS A			US88339J1051			1.200,00	81,204183	26/08/21					68,175000	726.350,09	1,68	1,46	1,23
VRTS US	USD	VIRTUS INVESTMENT			US92828Q1094			235,00	259,905702	29/04/21					314,420000	656.020,82	1,52	1,32	1,11
VRTX US	USD	PARTNERS VERTEX PHARMACEUTICALS INC			US92532F1003			550,00	195,383618	08/07/21					183,480000	895.964,95	2,08	1,81	1,52
GRUP TOPLAMI								32.473,00								38.759.205,56	89,78	78,17	65,69
GRUP TOPLAMI								122.963,00								43.172.809,54	100,00	87,07	73,16
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Eurobond Türk																			
XS1571399754	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	24/02/22	146	XS1571399754	3,70	2	300.000,00	104,699400	08/02/21	0,000000				101,909877	2.714.420,52	100,00	5,48	4,60
GRUP TOPLAMI								300.000,00								2.714.420,52	100,00	5,48	4,60
GRUP TOPLAMI								300.000,00								2.714.420,52	100,00	5,48	4,60
TPP BORÇLANMA																			
TPP BORÇLANMA																			
TPP			01/10/21	0		18,30		-1.548.776,12	18,300000	30/09/21				-1.548.776,12	18,300000	-1.548.776,12	100,00	-3,12	-2,62
GRUP TOPLAMI								-1.548.776,12								-1.548.776,12	100,00	-3,12	-2,62
GRUP TOPLAMI								-1.548.776,12								-1.548.776,12	100,00	-3,12	-2,62
TÜREV																			
Option																			
Call Alım																			
S&P 500 INDEX DEC2021 4200 C	USD		17/12/21		DEC2021 4200 C		0	1,00	221,650000	21/05/21					235,100000	208.733,54	73,62	0,42	0,35
S&P 500 INDEX DEC2021 4300 C	USD		17/12/21		DEC2021 4300 C		0	1,00	154,500000	25/06/21					152,050000	134.997,59	47,61	0,27	0,23
S&P 500 INDEX DEC2021 4400 C	USD		17/12/21		DEC2021 4400 C		0	3,00	137,666667	09/07/21					92,000000	245.046,60	86,43	0,49	0,42
Put Satım																			
S&P 500 INDEX DEC2021 3500 P	USD		17/12/21		DEC2021 3500 P		0	-1,00	159,500000	18/03/21					25,450000	-22.595,78	-7,97	-0,05	-0,04
S&P 500 INDEX DEC2021 3800 P	USD		17/12/21		DEC2021 3800 P		0	-1,00	131,150000	21/05/21					48,660000	-43.202,78	-15,24	-0,09	-0,07

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon																			
Eylül-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)
S&P 500 INDEX DEC2021 3900 P	USD		17/12/21		DEC2021 3900 P		0	-1,00	97,100000	25/06/21					62,700000	-55.668,20	-19,63	-0,11	-0,09
S&P 500 INDEX DEC2021 4000 P	USD		17/12/21		DEC2021 4000 P		0	-3,00	101,000000	09/07/21					69,000000	-183.784,95	-64,82	-0,37	-0,31
GRUP TOPLAMI								-1,00								283.526,02	100,00	0,56	0,49
GRUP TOPLAMI								-1,00								283.526,02	100,00	0,56	0,49
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								506.442,92								506.442,92	100,00	1,02	
GRUP TOPLAMI								506.442,92								506.442,92	100,00	1,02	
GRUP TOPLAMI								506.442,92								506.442,92	100,00	1,02	
VIOP USD Nakit Teminatı																			
VIOP USD Nakit Teminatı								501.966,16								4.456.706,55	100,00	1,01	
GRUP TOPLAMI								501.966,16								4.456.706,55	100,00	1,01	
GRUP TOPLAMI								501.966,16								4.456.706,55	100,00	1,01	
DİĞER																			
Döviz																			
EUR	EUR	EU			EUR			7.648,38	10,174721	30/09/21					10,293300	78.727,07	0,00	0,00	0,13
USD	USD	FED			USD			1.569.650,68	8,453348	30/09/21					8,878500	13.936.143,56	0,00	0,00	23,62
GRUP TOPLAMI								1.577.299,06								14.014.870,63	0,00	0,00	23,75
GRUP TOPLAMI								1.577.299,06								14.014.870,63	0,00	0,00	23,75
FON PORTFÖY DEĞERİ															49.585.129,43		92,02		

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	49.585.129,43	84,04 %
B-)HAZIR DEĞERLER	9.558.719,24	16,20 %
C-)ALACAKLAR	11.957,39	0,02 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-151.854,55	-0,26 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	59.003.951,51	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	1.055,43	0,0018 %
Fon Yönetim Ücreti	122.983,34	0,2084 %
Kayda Alma Ücreti	1.123,50	0,0019 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	16.613,04	0,0282 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	64,10	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	4.386,70	0,0074 %
Diğer Harcamalar	0,02	0,0000 %
BİST KYD Ücreti	360,00	0,0006 %
	146.586,13	0,2484 %

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

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

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

30.09.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
30.09.2021	01.10.2019	30.09.2021	Tarihsel_Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com
Mutlak Risk				Görel Risk				2013_Yaz	
FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kıstas RMD	Kıstas RMD/FTD	Görel Risk	Görel Risk Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
KRS-B	6.645.711,72	1.168.047,46	17,58%	20,00%				489.718,26	7,37%

KALDIRAÇ RAPORU

30.09.2021

	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRS-B (USD)	6.645.711,72	12.393,82	9.316,59	0,00	7,00	0,00	-	1.013,85

DUYARLILIK ANALİZİ

30.09.2021

		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 (%)
KRS-B (USD)	6.645.711,72	6.635.178,18	-10.533,54	-0,16		6.624.644,65	-21.067,07	-0,32		6.645.711,72	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 (%)
KRS-B (USD)	6.645.711,72	6.645.712,11	0,39	0,00		6.645.748,94	37,22	0,00		6.645.726,05	14,33	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 (%)
KRS-B (USD)	6.645.711,72	6.645.483,51	-228,21	0,00		6.629.967,74	-15.743,98	-0,24		6.637.312,80	-8.398,92	-0,13	
		Likidite Senaryo											
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)								
KRS-B (USD)	6.645.711,72	6.629.700,47	-16.011,25	-0,24									

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