

KRT_Aralık 2020 Portföy Dağılım Raporu

KRT_Aralık 2020 Portföy Dağılım Raporu			
1- FONU TANITICI BİLGİLER			
A. FONUN ADI:	Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)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:	17.392.024,76		
F. KATILMA PAYI SAYISI:	2.019.649,00		
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	43.406,00		
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZDİR		
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER			
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	8,61141		
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	8,90902		
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-3,34%		
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	28,14%		
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	28,14%		
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ			
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:			
Hisse Senedi			
Varant			
Devlet Tahvili			
Özel Sektör Tahvili			
Finansman Bonosu			
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			
Kıymetli Madenler			
VOB İşlemleri			
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0,0031		
Yabancı Sabit Getirili			
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	99,69%		
Opsiyon İşlemleri			
Yabancı Hisse Senetleri			
Vadeli Mevduat TL			
Vadeli Mevduat Döviz			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	7,71%		

H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:			
Hisse Senedi	-		
Devlet Borçlanma Senetleri	-		
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	499,79		
J. AYLIK KORELASYON :			
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :			
L. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN			
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	-		
M. KATILMA PAYI İADELERİNDEN			
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	0,00000000%		
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:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
XS1390320981	200.000,00	1.518.736,34	8,45%
XS1439838548	300.000,00	2.275.010,62	12,66%
XS1508914691	400.000,00	3.030.082,96	16,86%
XS1571399754	300.000,00	2.306.684,04	12,84%
XS1605397394	200.000,00	1.508.126,60	8,39%
XS1711581337	450.000,00	3.427.039,41	19,07%
XS1747548532	200.000,00	1.559.023,68	8,68%
XS1750996206	300.000,00	2.291.303,62	12,75%
TOPLAM :	2.350.000,00	17.916.007,28	99,70%
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
O) VOB İŞLEMLERİ:			

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	53.821,33	53.821,33	0,30%
TOPLAM :	53.821,33	53.821,33	0,30%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
FON PORTFÖY DEĞERİ	2.403.821,33	17.969.828,61	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	17.969.828,61	1,03	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	371.919,95	0,02	
C. ALACAKLAR (+) :	-	-	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	-	-	
E. BORÇLAR (-) :	955.958,38	0,06	
FON TOPLAM DEĞERİ:	17.385.790,18	44.196,00	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	16.667,06		
37002Denetim Ücreti	744,00		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	58,80		
37006Saklama Giderleri	6.627,25		
370142BİST Endeks K. Öltücü Kullanım bedeli	370,14		
37016Cari Yıl Vergileri	- 107.171,27		
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	270,10		
37045Fon Saklama Ücreti	1.198,71		
TOPLAM	- 81.235,21		
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI			
KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM.			
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA			
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR			
Açıklama	Nominal Değeri		
7- İTFALAR			
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nom. (1000 TL)	

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

KARE PORTFÖY TÜRKİYE ODAKLI SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_ARALIK 2020

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.12.2020

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.12.2020	02.01.2019	31.12.2020	Tarihsel Benzetim1	0,99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com
Mutlak Risk					Görelî Risk				
FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kıstas RMD	Kıstas RMD/FTD	Görelî RMD	Görelî RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
KRT-A	17.385.790,18	1.634.746,17	9,40%	20,00%	1.456.089,39	8,38%	1,12	1.021.867,24	5,88%
KRT-B	2.343.287,89	64.771,44	2,76%	20,00%	96.268,83	4,11%	0,67	49.940,56	2,13%

KALDIRAÇ RAPORU

31.12.2020

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-A	17.385.790,18	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80
KRT-B	2.343.287,89	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80

DUYARLILIK ANALİZİ

31.12.2020

FTD	Hisse -%10				Hisse -%20				USDTRY 10%				
	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 (%)	
KRT-A	17.385.790,18	17.385.790,18	0,00	0,00	0,00	17.385.790,18	0,00	0,00	0,00	19.193.554,14	1.807.763,96	10,40	9,87
KRT-B	2.343.287,89	2.343.287,89	0,00	0,00	0,00	2.343.287,89	0,00	0,00	0,00	2.343.287,89	0,00	0,00	0,00
FTD	US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps				TL Gov 300 bps				
	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 (%)	
KRT-A	17.385.790,18	17.385.790,18	0,00	0,00	-1,89	17.362.837,54	-22.952,64	-0,13	-6,11	17.385.790,18	0,00	0,00	-0,06
KRT-B	2.343.287,89	2.343.287,89	0,00	0,00	-1,89	2.340.194,29	-3.093,60	-0,13	-6,11	2.343.287,89	0,00	0,00	-0,06
FTD	SP500 -%5				Likidite Senaryo (KRC,KRT,KUB,KYA)				Likidite Senaryo (KRF)				
	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 (%)	
KRT-A	17.385.790,18	17.385.790,18	0,00	0,00	0,00	17.001.743,80	-384.046,38	-2,21	-8,03	17.374.229,22	-11.560,96	-0,07	-3,23
KRT-B	2.343.287,89	2.343.287,89	0,00	0,00	0,00	2.340.194,29	-3.093,60	-0,13	-6,18	2.341.729,68	-1.558,21	-0,07	-3,23
FTD	Likidite Senaryo (KPB)												
	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)									
KRT-A	17.385.790,18	17.362.837,54	-22.952,64	-0,13	-6,18								
KRT-B	2.343.287,89	2.340.194,29	-3.093,60	-0,13	-6,18								

Senaryolar:

- Duyarlılık:** ABD 10 yıllık faiz %1 yükseliş (100 bps şok) – ABD 10 yıllık faiz %2 yükseliş (tüm verim eğrisine 200 bps paralel şok) - USDTRY %10 yükseliş - TL gösterge faiz %3 yükseliş (TL hazine verim eğrisine 300 bps yukarı yönlü şok)
- Likidite :** Likidite riski, aşağıda yer verilen risk faktörlerine eşzamanlı şok uygulanarak hesaplanacaktır.
TR Hisse %15 Aşağı yönlü + TR Bono %4 Faiz yukarı yönlü + Yurtdışı Tahvil %2 Faiz yukarı yönlü + Varant %50 İskonto + ViOP (Grup bazında endeks) %2 ters yönlü
- Benchmark :** %40 BİST-KYD EUROBOND USD + %40 BİST-KYD ÖSBA EUROBOND USD + %20 BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD