

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Ocak-2021

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
B-)Kurucunun Ünvanı	:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.S
C-)Yöneticinin Ünvanı	:	KARE PORTFÖY YÖNETİMİ A.S
D-)Fon Tutarı	:	1.000.000.000,00
E-)Fon Pay Sayısı	:	100.000.000,00
F-)Fon Toplam Değeri	:	17.313.478,93
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	2.023.407,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	8,556597
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.168679
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	8,611410
Önceki Ay Pay Fiyatı (USD)	:	1.160661
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	-0,64
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	0.69
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	-0,64
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	24,94
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	14,25
d-) Özel Sektör Tahvili	:	0,00
e-)Devlet Tahvili Repo	:	0,00
f-) TPP	:	0,00
g-) Opsiyon	:	0,00
h-) Varant	:	0,00
i-)Değerli Maden	:	0,00
j-) Mevduat	:	0,00
k-) Katılım Hesabı	:	0,00
l-)Diğer	:	85,75
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	2,183
H-)Aylık Ortalama Portföy Devir Hızı	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,03
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00
I-)Portföyün Ortalama Vadesi	:	807,06

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLER				

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Ocak-2021

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
Eurobond				
XS1439838548	13/07/21	300.000,00	2.206.939,16	12,45
XS1571399754	24/02/22	300.000,00	2.292.181,54	12,93
XS1605397394	03/05/22	200.000,00	1.499.164,60	8,46
XS1750996206	16/01/23	300.000,00	2.226.701,16	12,56
XS1711581337	25/01/23	450.000,00	3.337.675,02	18,82
XS1747548532	26/01/23	200.000,00	1.499.175,03	8,46
XS1867595750	15/01/24	200.000,00	1.702.743,39	9,61
XS1617531063	24/05/27	400.000,00	2.952.172,63	16,66
	TOPLAM:	2.350.000,00	17.716.752,53	99,95
VOB Nakit Teminatı				
		8.193,22	8.193,22	0,05
	TOPLAM:	8.193,22	8.193,22	0,05
PORTFÖY DEĞERİ:		2.358.193,22	17.724.945,75	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	17.724.945,75	102,38 %
B-)HAZIR DEĞERLER	541.682,22	3,13 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	910.244,10	5,26 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	-931.696,57	-5,38 %
FON TOPLAM DEĞERİ	17.313.478,93	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	8,83	0,0001 %
Fon Yönetim Ücreti	15.468,62	0,0893 %
Kayda Alma Ücreti	927,03	0,0054 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	7.013,48	0,0405 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	30.781,62	0,1778 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	600,00	0,0035 %
BİST KYD Ücreti	334,32	0,0019 %
Kambiyo Vergi Tutarı	179,67	0,0010 %
TOPLAM:	55.313,57	0,3195 %

VI-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMMETÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Sirketin Unvani	İşlem Tipi	BDL-BDZ Tarihi	Nominal Değeri	TUTAR
-----------------	------------	----------------	----------------	-------

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Ocak-2021

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
USD	1.743.660,000	2.026.452,63	1.747.418,000	2.030.980,95

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

KARE PORTFÖY TÜRKİYE ODAKLI SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_OCAK 2021

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

29.01.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi	
29.01.2021	30.01.2019	29.01.2021	Tarihsel Benzetim1	0,99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com	
Mutlak Risk					Görelî Risk					
FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kistas RMD	Kistas RMD/FTD	Görelî RMD	Görelî RMD Limit	Stres RMD	2013 Yaz Stres RMD/FTD	
KRT-A	17.313.478,93	1.633.731,95	9,44%	20,00%	1.451.273,42	8,38%	1,13	1,75	1.034.160,00	5,97%
KRT-B	2.364.712,48	107.279,10	4,54%	20,00%	97.478,92	4,12%	1,10	1,75	106.788,82	4,52%

KALDIRAÇ RAPORU

29.01.2021

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-A	17.313.478,93	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80
KRT-B	2.364.712,48	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80

DUYARLILIK ANALİZİ

29.01.2021

FTD	Hisse -%10					Hisse -%20					USDTRY 10%				
	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-A	17.313.478,93	17.313.478,93	0,00	0,00	0,00	17.313.478,93	0,00	0,00	0,00	0,00	19.158.749,05	1.845.270,12	10,66	9,87	
KRT-B	2.364.712,48	2.364.712,48	0,00	0,00	0,00	2.364.712,48	0,00	0,00	0,00	0,00	2.364.712,48	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 (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-A	17.313.478,93	17.237.730,50	-75.748,43	-0,44	-1,84	16.814.374,45	-499.104,48	-2,88	-5,95	-5,95	17.313.478,93	0,00	0,00	0,00	-0,06
KRT-B	2.364.712,48	2.354.366,60	-10.345,89	-0,44	-1,84	2.296.543,71	-68.168,77	-2,88	-5,95	-5,95	2.364.712,48	0,00	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 (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-A	17.313.478,93	17.313.478,93	0,00	0,00	0,00	16.455.302,52	-858.176,41	-4,96	-7,88	-7,88	17.055.481,84	-257.997,09	-1,49	-3,15	-3,15
KRT-B	2.364.712,48	2.364.712,48	0,00	0,00	0,00	2.296.543,71	-68.168,77	-2,88	-6,03	-6,03	2.329.474,68	-35.237,80	-1,49	-3,15	-3,15
FTD	Likidite Senaryo (KPB)														
	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)										
KRT-A	17.313.478,93	16.814.374,45	-499.104,48	-2,88	-6,03										
KRT-B	2.364.712,48	2.296.543,71	-68.168,77	-2,88	-6,03										

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