

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Şubat-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	:	29.845.624,96
G-)Tedavüldeki Pay Sayısı	:	3.445.529,000
H-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
I-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	8,662131
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.175196
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	8,556597
Önceki Ay Pay Fiyatı (USD)	:	1.168679
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	1,23
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	0,56
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0,59
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	23,64
F-)Ortalama Menkul Kıymet Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	86,31
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	:	13,69
G-)Aylık Ortalama Tedavül Oranı	:	2,956
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	:	856,14
l-)KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ (USD)	:	1.745.019,000000
J-)KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI (USD)	:	75.268,770000

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

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MK KODU	İHRAÇCI KURUM	VADE	NOMİNAL DEĞER	RAYİÇ DEĞERİ	ORAN%
BORÇLANMA SENETLERİ					
Eurobond					
XS1439838548	T. HALK BANKASI A.Ş.	13/07/21	300.000,00	2.236.296,38	7,89
XS1605397394	TC ZIRAAT BANKASI	03/05/22	200.000,00	1.519.178,02	5,36
XS1750996206	TÜRKİYE SINAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	16/01/23	300.000,00	2.271.517,19	8,01
XS1711581337	FIBABANKA	25/01/23	650.000,00	4.915.294,46	17,32
XS1747548532	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	200.000,00	1.519.920,35	5,36
XS1760780731	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/01/23	200.000,00	1.522.377,55	5,37
XS1003016018	T.İŞ BANKASI A.S.	11/12/23	200.000,00	1.600.901,61	5,65
XS1867595750	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	200.000,00	1.728.166,65	6,10
XS1578203462	T.İŞ BANKASI A.S.	25/04/24	400.000,00	3.125.230,51	11,02
XS1634372954	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	21/06/24	200.000,00	1.547.350,43	5,46
XS1958649854	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/10/24	200.000,00	1.682.826,94	5,94
XS1617531063	GARANTI BANKASI	24/05/27	400.000,00	3.006.666,04	10,61
NO0010894330	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	200.000,00	1.549.827,42	5,47
	TOPLAM:		3.650.000,00	28.225.553,55	99,56
VOB Nakit Teminatı					
VOB Nakit Teminatı			125.454,66	125.454,66	0,44
	TOPLAM:		125.454,66	125.454,66	0,44
PORTFÖY DEĞERİ:		3.775.454,66		28.351.008,21	100,00

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	28.351.008,21	94,99 %
B-)HAZIR DEĞERLER	2.451.353,40	8,21 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	906.656,49	3,04 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	-931.696,57	-3,12 %
FON TOPLAM DEĞERİ	29.845.624,96	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	20.686,15	0,0693 %

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

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Kayda Alma Ücreti	375,56	0,0013 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	8.347,42	0,0280 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	164,00	0,0005 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	690,00	0,0023 %
Diğer Harcamalar	2.936,95	0,0098 %
BİST KYD Ücreti	334,32	0,0011 %
TOPLAM:	33.534,40	0,1123 %

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, 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

VII-KATILIMCIYA YAPILAN FON PAY SATIM VE GERİ ALIM İŞLEMLERİ

Döviz Cinsi	Alış Miktarı	Alış Tutarı	Satış Miktarı	Satış Tutarı
USD	64.405,000	75.268,77	1.486.527,000	1.745.019,00

KARE PORTFÖY TÜRKİYE ODAKLI SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RISK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU ŞUBAT 2021

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

26.02.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Biliş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örnekleme Sayısı	Elide Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
26.02.2021	27.02.2019	26.02.2021	Tarihsel_Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com

FTD	KRT-A	KRT-B	Mutlak Risk			Görel Risk			2013 Yaz		
			RMD/FTD	RMD/FTD	RMD/FTD	Kıstas RMD	Kıstas RMD/FTD	Görel RMD	Görel RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
29.845.624,96	2.586.346,29	185.233,52	8,67%	20,00%	2.499.304,53	8,37%	1,03	1.690.350,05	1,75	1.690.350,05	5,66%
4.049.170,37	4,57%	171.695,93	4,24%	20,00%	171.695,93	4,24%	1,08	213.065,04	1,75	213.065,04	5,26%

KALDIRAÇ RAPORU

26.02.2021

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraç İşlem RMD
29.845.624,96	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-
4.049.170,37	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-

DUYARLILIK ANALİZİ

26.02.2021

FTD	KRT-A	KRT-B	Hisse %10			Hisse %20			USDTRY 10%		
			Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
29.845.624,96	29.845.624,96	4.049.170,37	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	32.777.008,95	9,82	9,82	9,87
4.049.170,37	4.049.170,37	-	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4.049.170,37	0,00	0,00	0,00

FTD	KRT-A	KRT-B	US Gov 10yr 100bps			US Gov 200bps			TL Gov 300bps		
			Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
29.845.624,96	29.739.898,18	-105.726,78	-0,35	-1,79	28.811.381,08	-10,34	-243,88	29.845.624,96	0,00	0,00	-0,06
4.049.170,37	4.034.826,37	-14.344,00	-0,35	-1,79	3.908.854,00	-140,316,37	-3,47	4.049.170,37	0,00	0,00	-0,06

FTD	KRT-A	KRT-B	SP500 %5			Likidite Senaryo (KRC,KRT,KUB,KYA)					
			Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)			
29.845.624,96	29.845.624,96	4.049.170,37	0,00	0,00	0,00	28.245.789,16	-1,599	835,80	-5,36	-5,36	-3,08
4.049.170,37	4.049.170,37	-	0,00	0,00	0,00	3.908.854,00	-140,316,37	-3,47	-3,47	-3,47	-3,08

Senaryolar:

FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
29.845.624,96	28.811.381,08	-10,34	243,88
4.049.170,37	3.908.854,00	-140,316,37	-3,47

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 + VİOP (Grup bazında endeks) %2 ters yönlü

Benchmark:

%40 BIST-KYD EUROBOND USD + %40 BIST-KYD ÖSBA EUROBOND USD + %20 BIST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD