

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

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı 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	:	27.906.631,89
E-) Katılma Payı Sayısı	:	2.771.656,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	10,068577
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.184678
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	9,642662
Önceki Ay Pay Fiyatı (USD)	:	1.171491
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	4,42
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	1.13
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	16,92
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	31,30
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	0,00
d-)Özel Sektör Tahvili	:	97,91
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	0,00
h-)Opsiyon	:	0,00
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,00
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	2,09
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	:	0,00
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

:	:	877,74
---	---	--------

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit

Girişleri (TL)	:	0,00
----------------	---	------

II-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit

Girişleri (USD)	:	26.688,640000
-----------------	---	---------------

I-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit

Çıkışları (TL)	:	0,00
----------------	---	------

II-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit

Çıkışları (USD)	:	496,630000
-----------------	---	------------

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 SOZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Eurobond Türk																			
XS1750996206	USD	TÜRKİYE SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	16/01/23	594	XS1750996206	5,72	2	300.000,00	101,317000	12/11/20	0,000000				103,968247	2.650.878,38	9,68	9,62	9,50
XS1711581337	USD	FİBABANK A.Ş.	25/01/23	603	XS1711581337	5,06	2	450.000,00	95,244000	19/03/21	0,000000				102,592233	3.923.691,24	14,32	14,23	14,06
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	604	XS1747548532	5,31	2	200.000,00	102,879000	12/11/20	0,000000				104,718986	1.780.013,33	6,50	6,46	6,38
XS1760780731	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/01/23	608	XS1760780731	4,02	2	200.000,00	103,567400	23/02/21	0,000000				104,619164	1.778.316,56	6,49	6,45	6,37
XS1496463297	USD	EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY T.Ş.	24/10/23	875	XS1496463297	4,69	2	300.000,00	101,659700	28/04/21	0,000000				102,933863	2.624.504,71	9,58	9,52	9,40
XS1003016018	USD	T.Ş. BANKASI A.Ş.	11/12/23	923	XS1003016018	4,77	2	200.000,00	109,504600	19/02/21	0,000000				109,100178	1.854.484,83	6,77	6,73	6,65
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	958	XS1867595750	8,13	2	200.000,00	115,186300	21/01/21	0,000000				120,169863	2.042.647,33	7,46	7,41	7,32

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

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRACCI 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)
XS1917720911	USD	TÜRKİYE İHRACAT KREDİ BANKASI AŞ	24/01/24	967	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	0,000000				111,245548	1.890.951,82	6,90	6,86	6,78
XS1578203462	USD	T.İ.S BANKASI A.Ş.	25/04/24	1059	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	0,000000				104,386110	1.774.355,09	6,48	6,44	6,36
XS1958649854	USD	YATIRIM KREDİ BANKASI A.Ş.	15/10/24	1232	XS1958649854	4,66	2	200.000,00	114,635400	10/02/21	0,000000				109,947726	1.868.891,45	6,82	6,78	6,70
XS1617531063	USD	GARANTİ BANKASI	24/05/27	2183	XS1617531063	6,22	2	400.000,00	100,450800	21/01/21	0,000000				100,137466	3.404.273,29	12,43	12,35	12,20
GRUP TOPLAMI								2.850.000,00								25.593.008,03	93,43	92,85	91,72
Eurobond Yabancı																			
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	1596	NO0010894330	8,13	2	200.000,00	105,997400	19/03/21	0,000000				105,849096	1.799.222,93	6,57	6,53	6,45
GRUP TOPLAMI								200.000,00								1.799.222,93	6,57	6,53	6,45
GRUP TOPLAMI								3.050.000,00								27.392.230,96	100,00	99,38	98,17
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								171.305,44								171.305,44	100,00	0,62	
GRUP TOPLAMI								171.305,44								171.305,44	100,00	0,62	
GRUP TOPLAMI								171.305,44								171.305,44	100,00	0,62	
Diğer																			
Döviz																			
USD	USD	FED			USD			43.722,45	8,273000	31/05/21				8,499000	371.597,10	0,00	0,00	1,33	
GRUP TOPLAMI								43.722,45							371.597,10	0,00	0,00	1,33	
GRUP TOPLAMI								43.722,45							371.597,10	0,00	0,00	1,33	
FON PORTFÖY DEĞERİ																27.563.536,40		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	27.563.536,40	98,77 %
B-)HAZIR DEĞERLER	374.306,04	1,34 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-31.210,55	-0,11 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	27.906.631,89	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	23.747,15	0,0851 %
Kayda Alma Ücreti	438,64	0,0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	9.197,10	0,0330 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	240,14	0,0009 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	829,20	0,0030 %
Diğer Harcamalar	413,00	0,0015 %
BİST KYD Ücreti	410,35	0,0015 %
	35.275,58	0,1266 %

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

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

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

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

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

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.05.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.05.2021	28.05.2019	31.05.2021	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 RMD	Görel RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
KRT-A	27.906.631,89	1.682.173,66	6,03%	20,00%	2.166.868,06	7,76%	0,78	1,75	4,50%
KRT-B	3.283.519,46	167.047,08	5,09%	20,00%	151.353,11	4,61%	1,10	1,75	5,25%

KALDIRAÇ RAPORU

31.05.2021

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraç İşlem RMD
KRT-A	27.906.631,89	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-
KRT-B	3.283.519,46	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-

DUYARLILIK ANALİZİ

31.05.2021

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	27.906.631,89	27.906.631,89	0,00	0,00	27.906.631,89	0,00	0,00	0,00	30.032.813,87	2.126.181,98	7,62	10,00	
KRT-B	3.283.519,46	3.283.519,46	0,00	0,00	3.283.519,46	0,00	0,00	0,00	3.283.519,46	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	27.906.631,89	27.814.046,28	-92.585,61	-0,33	-1,76	27.011.972,86	-894.659,03	-3,21	-5,82	27.906.631,89	0,00	0,00	0,00
KRT-B	3.283.519,46	3.272.625,75	-10.893,71	-0,33	-1,76	3.178.253,07	-105.266,39	-3,21	-5,82	3.283.519,46	0,00	0,00	0,00
FTD	SP500 -%5				Likidite Senaryo								
	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)					
KRT-A	27.906.631,89	27.906.631,89	0,00	0,00	27.011.972,86	-894.659,03	-3,21	-5,82					
KRT-B	3.283.519,46	3.283.519,46	0,00	0,00	3.178.253,07	-105.266,39	-3,21	-5,82					

KRT-A Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz) Fon (TRY)

Karşılaştırma Ölçütü : %40 BİST-KYD EUROBOND USD + %40 BİST-KYD ÖSBA EUROBOND USD + %20 BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD

KRT-B Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz) Fon (USD)

Karşılaştırma Ölçütü : %40 BİST-KYD EUROBOND USD + %40 BİST-KYD ÖSBA EUROBOND USD + %20 BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD

RMD Yöntemi Görel RMD

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

SP500 -%5 SP500 endeksinde aşağı yönlü 5% şok

Likidite Senaryo Eşzamanlı olarak;