

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Ağustos-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-)Toplam Değer/Net Varlık Değeri	:	47.737.989,24
E-) Katılma Payı Sayısı	:	4.748.010,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	10,054315
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.210736
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	10,113551
Önceki Ay Pay Fiyatı (USD)	:	1.202005
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	-0,59
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	0,73
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	16,76
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	22,70
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	13,84
d-)Özel Sektör Tahvili	:	86,05
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	:	0,11
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 Vadeleri

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	300.574,710000
II-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00
II-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)	:	0,000000

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

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)
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Eurobond Türk																			
XS1750996206	USD	TÜRKİYE SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	16/01/23	502	XS1750996206	5,72	2	300.000,00	101,317000	12/11/20	0,000000				103,864151	2.587.557,20	5,79	5,78	5,42
XS1711581337	USD	FİBANK A.Ş.	25/01/23	511	XS1711581337	4,33	2	1.000.000,00	100,674000	16/07/21	0,000000				102,933219	8.547.883,32	19,12	19,13	17,91
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	512	XS1747548532	5,31	2	200.000,00	102,879000	12/11/20	0,000000				103,114452	1.712.586,69	3,83	3,83	3,59
XS1760780731	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/01/23	516	XS1760780731	4,02	2	200.000,00	103,567400	23/02/21	0,000000				104,091110	1.728.807,60	3,87	3,86	3,62
XS1496463297	USD	TÜRKİYE İHRACAT KREDİ BANKASI AS	24/10/23	783	XS1496463297	4,69	2	300.000,00	101,659700	28/04/21	0,000000				105,703658	2.633.384,65	5,89	5,89	5,52
XS1003016018	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	11/12/23	831	XS1003016018	4,77	2	200.000,00	109,504600	19/02/21	0,000000				110,019562	1.827.270,89	4,09	4,08	3,83
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.	15/01/24	866	XS1867595750	8,13	2	200.000,00	115,186300	21/01/21	0,000000				118,800644	1.973.112,37	4,41	4,41	4,13

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

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRACÇI 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	Ş. TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI	24/01/24	875	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	0,000000				110,429904	1.834.086,11	4,10	4,10	3,84
XS1578203462	USD	AS T.İŞ BANKASI	25/04/24	967	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	0,000000				106,430945	1.767.669,00	3,96	3,95	3,70
XS1958649854	USD	A.S. YAPI VE KREDİ BANKASI	15/10/24	1140	XS1958649854	5,14	2	570.000,00	112,359400	07/07/21	0,000000				113,455178	5.370.345,26	12,02	12,00	11,25
XS1686704948	USD	A.Ş. TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	18/10/24	1143	XS1686704948	4,23	2	200.000,00	102,100000	02/08/21	0,000000				102,436384	1.701.324,92	3,81	3,80	3,56
XS1584113184	USD	T.SINAI KALKINMA BANKASI	29/03/27	2035	XS1584113184	7,22	2	300.000,00	103,950700	07/07/21	0,000000				104,725014	2.609.003,79	5,84	5,83	5,47
XS1617531063	USD	A.Ş. GARANTİ BANKASI	24/05/27	2091	XS1617531063	5,94	2	800.000,00	100,968200	07/07/21	0,000000				102,927301	6.837.913,51	15,30	15,28	14,32
GRUP TOPLAMI								4.670.000,00								41.130.945,31	92,03	91,94	86,16
Eurobond Yabancı																			
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	1504	NO0010894330	7,84	2	400.000,00	106,563100	07/07/21	0,000000				107,262603	3.562.963,33	7,97	7,96	7,46
GRUP TOPLAMI								400.000,00								3.562.963,33	7,97	7,96	7,46
GRUP TOPLAMI								5.070.000,00								44.693.908,64	100,00	99,90	93,62
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı								45.942,79								45.942,79	100,00	0,10	
GRUP TOPLAMI								45.942,79								45.942,79	100,00	0,10	
GRUP TOPLAMI								45.942,79							45.942,79	100,00	0,10		
DİĞER																			
Döviz																			
USD	USD	FED			USD			366.846,41	8,619307	31/08/21				8,304300	3.046.402,64	0,00	0,00	6,38	
GRUP TOPLAMI								366.846,41							3.046.402,64	0,00	0,00	6,38	
GRUP TOPLAMI								366.846,41							3.046.402,64	0,00	0,00	6,38	
FON PORTFÖY DEĞERİ																44.739.851,43		100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	44.739.851,43	93,72 %
B-)HAZIR DEĞERLER	3.048.171,07	6,39 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-50.033,26	-0,10 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	47.737.989,24	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	43.021,42	0,0901 %
Kayda Alma Ücreti	794,89	0,0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	12.056,14	0,0253 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	164,00	0,0003 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.454,00	0,0030 %
BİST KYD Ücreti	424,50	0,0009 %
	57.914,95	0,1213 %

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

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

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.08.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.08.2021	29.08.2019	31.08.2021	Tarihsel_Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com
Mutlak Risk				Görelî Risk				2013_Yaz	
FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kıstas RMD	Kıstas RMD/FTD	Görelî RMD	Görelî RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
KRT-B (USD)	5.748.586,79	328.809,34	5,72%	20,00%	242.079,71	4,21%	1,36	334.022,11	5,81%

KALDIRAÇ RAPORU

31.08.2021

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-B (USD)	5.748.586,79	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-

DUYARLILIK ANALİZİ

30.07.2021

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-B (USD)	5.407.100,96	5.407.100,96	0,00	0,00	5.407.100,96	0,00	0,00	0,00	5.407.100,96	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-B (USD)	5.407.100,96	5.392.968,26	-14.132,70	-0,26	5.182.181,70	-224.919,26	-4,16	-5,80	5.407.100,96	0,00	0,00	0,00
FTD	SP500 -%5				Likidite Senaryo				Likidite Senaryo			
	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-B (USD)	5.407.100,96	5.407.100,96	0,00	0,00	5.182.181,70	-224.919,26	-4,16	-5,80	5.291.959,42	-115.141,54	-2,13	-3,03
FTD	Likidite Senaryo											
	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)								
KRT-B (USD)	5.407.100,96	5.182.181,70	-224.919,26	-4,16	-5,80							

KRT-A Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz) Fon (TRY)
Karşılaştırma Ölçütü : %40 BİST-KYD EURO BOND USD + %40 BİST-KYD ÖSBA EURO BOND USD + %20 BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD

KRT-B Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz) Fon (USD)
Karşılaştırma Ölçütü : %40 BİST-KYD EURO BOND USD + %40 BİST-KYD ÖSBA EURO BOND USD + %20 BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD

RMD Yöntemi Görelî 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 endeksine aşağı yönlü 5% şok
Likidite Senaryo	Eşzamanlı olarak;