

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Ekim-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	:	95.603.948,02
E-) Katılma Payı Sayısı	:	8.360.721,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	11,434893
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.206047
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	10,707680
Önceki Ay Pay Fiyatı (USD)	:	1.206024
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	6,79
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	0.00
D-)Yılıbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	32,79
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	24,17
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	24,64
d-)Özel Sektör Tahvili	:	75,31
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	:	0,05
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	:	0,01
d-)Opsiyon	:	0,00
e-)Varant	:	0,00
f-)Diğer	:	0,00

H-)Portföyün Ortalama Vadesi

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	4.371.341,370000

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)	:	13.909,940000

**III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU**

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	IHRACCI 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)
<b>BORÇLANMA SENETLERİ</b>																			
<b>Eurobond Türk</b>																			
XS1711581337	USD	FIBABANK A	25/01/23	450	XS1711581337	4,33	2	1.000.000,00	100,674000	16/07/21	0,000000				103,630959	9.825.562,11	11,20	11,20	10,28
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	451	XS1747548532	4,38	2	500.000,00	103,110600	27/10/21	0,000000				103,206301	4.892.649,53	5,58	5,58	5,12
XS1496463297	USD	TÜRKİYE İHRACAT KREDİ BANKASI A.Ş.	24/10/23	722	XS1496463297	4,69	2	300.000,00	101,659700	28/04/21	0,000000				101,799082	2.895.562,91	3,30	3,30	3,03
XS1003016018	USD	T.İŞ BANKASI A.S.	11/12/23	770	XS1003016018	4,77	2	200.000,00	109,504600	19/02/21	0,000000				109,519479	2.076.774,08	2,37	2,37	2,17
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	805	XS1867595750	8,13	2	200.000,00	115,186300	21/01/21	0,000000				117,584479	2.229.707,45	2,54	2,54	2,33
XS1917720911	USD	TÜRKİYE İHRACAT KREDİ BANKASI A.Ş.	24/01/24	814	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	0,000000				108,776671	2.062.688,51	2,35	2,35	2,16
XS1578203462	USD	T.İŞ BANKASI A.S.	25/04/24	906	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	0,000000				102,710685	1.947.661,63	2,22	2,22	2,04

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

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 SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)	
XS1958649854	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/10/24	1079	XS1958649854	4,43	2	770.000,00	112,827800	03/09/21	0,000000				108,004644	7.884.988,11	8,99	8,99	8,25	
XS1686704948	USD	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	18/10/24	1082	XS1686704948	4,51	2	400.000,00	101,047500	20/10/21	0,000000				99,488274	3.773.112,69	4,30	4,30	3,95	
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24	1109	US900123CW86	5,29	2	2.500.000,00	103,714800	28/10/21	0,000000				103,614219	24.559.937,41	28,02	28,00	25,69	
XS1584113184	USD	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	29/03/27	1974	XS1584113184	7,22	2	300.000,00	103,950700	07/07/21	0,000000				101,285493	2.880.954,44	3,28	3,28	3,01	
XS1617531063	USD	GARANTİ BANKASI	24/05/27	2030	XS1617531063	5,98	2	1.100.000,00	102,501600	26/10/21	0,000000				103,095932	10.752.318,01	12,26	12,26	11,25	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>7.670.000,00</b>								<b>75.781.916,88</b>	<b>86,41</b>	<b>86,39</b>	<b>79,28</b>	
<b>Eurobond Yabancı</b>																				
NO0010852643	USD	DNO ASA	29/05/24	940	NO0010852643	6,47	4	400.000,00	105,102500	22/10/21	0,000000				105,515548	4.001.698,26	4,56	4,56	4,19	
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV CREDIT EUROPE BANK	14/10/25	1443	NO0010894330	7,94	2	600.000,00	105,901300	22/10/21	0,000000				104,485822	5.943.968,54	6,78	6,78	6,22	
XS1706923148	USD	GENEL ENERGY FIN IV CREDIT EUROPE BANK	09/11/27	2199	XS1706923148	7,06	2	200.000,00	103,607800	17/09/21	0,000000				104,245027	1.976.756,76	2,25	2,25	2,07	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>1.200.000,00</b>								<b>11.922.423,56</b>	<b>13,59</b>	<b>13,59</b>	<b>12,48</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>8.870.000,00</b>									<b>87.704.340,44</b>	<b>100,00</b>	<b>99,98</b>	<b>91,76</b>
<b>VIOP Nakit Teminatı</b>																				
VIOP Nakit Teminatı								17.919,77								17.919,77	100,00	0,02		
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>17.919,77</b>									<b>17.919,77</b>	<b>100,00</b>	<b>0,02</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>17.919,77</b>								<b>17.919,77</b>	<b>100,00</b>	<b>0,02</b>		
<b>DİĞER</b>																				
<b>Döviz</b>																				
USD	USD	FED			USD			839.273,59	9,168439	28/10/21				9,481300	7.957.404,69	0,00	0,00	8,32		
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>839.273,59</b>								<b>7.957.404,69</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8,32</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>839.273,59</b>								<b>7.957.404,69</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8,32</b>	
<b>FON PORTFÖY DEĞERİ</b>																<b>87.722.260,21</b>		<b>100,00</b>		

**IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	87.722.260,21	91,76 %
B-)HAZIR DEĞERLER	7.958.685,50	8,32 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-76.997,69	-0,08 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
<b>FON TOPLAM DEĞERİ</b>	<b>95.603.948,02</b>	<b>100,00 %</b>

**V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	67.118,54	0,0702 %
Kayda Alma Ücreti	1.212,50	0,0013 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	12.756,93	0,0133 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	64,10	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.075,70	0,0011 %
BİST KYD Ücreti	438,65	0,0005 %
	82.666,42	0,0865 %

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

# KARE PORTFÖY TÜRKİYE ODAKLI SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU\_EKİM 2021

## RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

28.10.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi	
28.10.2021	30.10.2019	28.10.2021	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-B (USD)	10.083.421,90	654.251,59	6,49%	20,00%	467.644,12	4,64%	1,40	1,75	753.248,18	7,47%

## KALDIRAÇ RAPORU

28.10.2021

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-B (USD)	10.083.421,90	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80

## DUYARLILIK ANALİZİ

28.10.2021

FTD	Hisse -%10				Hisse -%20				USDTRY 10%				
	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	
KRT-B (USD)	10.083.421,90	10.083.421,90	0,00	0,00	0,00	10.083.421,90	0,00	0,00	0,00	10.083.421,90	0,00	0,00	0,00
FTD	US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps				TL Gov 300 bps				
	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	
KRT-B (USD)	10.083.421,90	10.067.266,42	-16.155,48	-0,16	-1,70	9.670.929,03	-412.492,86	-4,09	-5,68	10.083.421,90	0,00	0,00	0,00
FTD	SP500 -%5				Likidite Senaryo				Likidite Senaryo				
	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	
KRT-B (USD)	10.083.421,90	10.083.421,90	0,00	0,00	0,00	9.670.929,03	-412.492,86	-4,09	-5,68	9.872.740,46	-210.681,44	-2,09	-2,96
FTD	Likidite Senaryo												
	Şok Sonrası Port.	Port. Değişim	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)									
KRT-B (USD)	10.083.421,90	9.670.929,03	-412.492,86	-4,09	-5,68								

KRT-A	Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz) Fon Karşılaştırma Ölçütü : %40 BİST-KYD EURO BOND USD + %40 BIST-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 BIST-KYD ÖSBA EURO BOND 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 endeksine aşağı yönlü 5% şok
Likidite Senaryo	Eşzamanlı olarak;