

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Temmuz-2022

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	:	246.240.296,47
E-) Katılma Payı Sayısı	:	12.052.869,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	20,430015
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.141731
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	19,014742
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	1.141245
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	7,44
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	0,04
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	29,54
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	102,01
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	36,74
d-)Özel Sektör Tahvili	:	63,17
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	:	0,09
o-)Yatırım Fonu	:	0,00
p-)Borsa Yatırım Fonu	:	0,00
r-)Repo-Trepo	:	0,00
s-)Taahhütlü Alış-Satış İşlemleri	:	0,00
t-) Vaad Sözleşmesi 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	:	469,36

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

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD) : 11.466,040000

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

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD) : 98.819,330000

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 SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
BORÇLANMA SENETLERİ																			
Eurobond Türk																			
XS1711581337	USD	FIBABANK A	25/01/23	177	XS1711581337	4,33	2	1.000.000,00	100,674000	16/07/21	14,769590				96,291630	17.230.328,01	7,32	7,31	7,00
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	178	XS1747548532	5,86	2	900.000,00	102,156100	25/03/22	11,438751				97,599479	15.717.917,93	6,67	6,67	6,38
XS1496463297	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI A.Ş.	24/10/23	449	XS1496463297	6,05	2	1.300.000,00	101,416900	01/04/22	12,089723				94,263151	21.927.560,10	9,31	9,30	8,90
XS1003016018	USD	T.İŞ BANKASI A.S.	11/12/23	497	XS1003016018	5,34	2	400.000,00	108,991700	01/12/21	10,204560				98,398849	7.042.956,68	2,99	2,99	2,86
US900123CR91	USD	HAZİNE	25/12/23	511	US900123CR91	5,89	2	700.000,00	104,637500	29/04/22	7,560527				100,450795	12.582.195,30	5,34	5,34	5,11
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	532	XS1867595750	8,00	2	1.200.000,00	114,617800	01/04/22	12,694865				102,547219	22.019.636,22	9,35	9,34	8,94
XS1917720911	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ	24/01/24	541	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	11,137253				96,638219	3.458.469,26	1,47	1,47	1,40

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Temmuz-2022**

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)	
XS1578203462	USD	BANKASI AS T.İŞ BANKASI	25/04/24	633	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	11,175984				94,225740	3.372.131,93	1,43	1,43	1,37	
XS1958649854	USD	A.S. YAPI VE KREDİ BANKASI	15/10/24	806	XS1958649854	4,43	2	770.000,00	112,827800	03/09/21	11,020827				97,582493	13.445.211,58	5,71	5,70	5,46	
XS1686704948	USD	A.S. TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİL ERİ A.Ş.	18/10/24	809	XS1686704948	4,51	2	400.000,00	101,047500	20/10/21	10,271302				90,502192	6.477.748,68	2,75	2,75	2,63	
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24	836	US900123CW86	6,59	2	3.000.000,00	101,964600	08/12/21	10,138917				92,533712	49.673.669,85	21,09	21,07	20,17	
XS1617531063	USD	GARANTİ BANKASI	24/05/27	1757	XS1617531063	6,51	2	2.500.000,00	101,932600	16/03/22	12,047336				84,652085	37.868.898,56	16,08	16,06	15,38	
GRUP TOPLAMI								12.570.000,00								210.816.724,10	89,51	89,43	85,60	
Eurobond Yabancı																				
NO0010852643	USD	DNO ASA	29/05/24	667	NO0010852643	6,47	4	187.324,00	105,102500	31/05/22	8,757758				101,190548	3.391.863,58	1,44	1,44	1,38	
NO0011002495	USD	HKN ENERGY LTD	26/05/25	1029	NO0011002495	11,80	2	200.000,00	104,050700	14/03/22	12,982005				100,668863	3.602.717,14	1,53	1,53	1,46	
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	1170	NO0010894330	7,94	2	600.000,00	105,901300	22/10/21	9,888005				101,529986	10.900.604,53	4,63	4,62	4,43	
NO0011088593	USD	DNO ASA	09/09/26	1500	NO0011088593	7,78	4	200.000,00	102,187300	03/03/22	10,095465				94,795918	3.392.537,35	1,44	1,44	1,38	
XS1706923148	USD	CREDIT EUROPE BANK	09/11/27	1926	XS1706923148	7,06	2	200.000,00	103,607800	17/09/21	8,899249				95,568630	3.420.191,02	1,45	1,45	1,39	
GRUP TOPLAMI								1.387.324,00								24.707.913,62	10,49	10,48	10,04	
GRUP TOPLAMI								13.957.324,00									235.524.637,72	100,00	99,91	95,64
VIOP Nakit Teminatı																				
VIOP Nakit Teminatı								209.770,07								209.770,07	100,00	0,09		
GRUP TOPLAMI								209.770,07									209.770,07	100,00	0,09	
GRUP TOPLAMI								209.770,07									209.770,07	100,00	0,09	
DİĞER																				
Döviz																				
USD	USD	FED			USD			657.608,17	16,662943	29/07/22					17,893900	11.767.174,83	0,00	0,00	4,78	
GRUP TOPLAMI								657.608,17								11.767.174,83	0,00	0,00	4,78	
GRUP TOPLAMI								657.608,17								11.767.174,83	0,00	0,00	4,78	
FON PORTFÖY DEĞERİ																235.734.407,79			100,00	

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	235.734.407,79	95,73 %
B-)HAZIR DEĞERLER	11.769.146,21	4,78 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-1.263.257,53	-0,51 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	246.240.296,47	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	223.102,20	0,0906 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	623,41	0,0003 %
Kayda Alma Ücreti	4.119,45	0,0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	31.867,18	0,0129 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	87,30	0,0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.986,23	0,0008 %
BİST KYD Ücreti	1.758,42	0,0007 %
E Defter Ücreti	290,16	0,0001 %
	263.834,35	0,1071 %

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELİZ HİSSE SENEDİ ALIM, 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_TEMMUZ 2022

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

29.07.2022

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi	
29.07.2022	29.07.2020	29.07.2022	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	13.761.130,69	1.088.627,16	7,91%	20,00%	774.195,70	5,63%	1,41	1,75	1.328.663,06	9,66%

KALDIRAÇ RAPORU

29.07.2022

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-B	13.761.130,69	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80

DUYARLILIK ANALİZİ

29.07.2022

FTD	Hisse -%10				Hisse -%20				USDTRY 10%			
	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-B	13.761.130,69	13.761.130,69	0,00	0,00	13.761.130,69	0,00	0,00	0,00	13.761.130,69	0,00	0,00	0,00
FTD	US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps				TL Gov 300 bps			
	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-B	13.761.130,69	13.727.707,58	-33.423,11	-0,24	13.257.667,47	-503.463,22	-3,66	-4,60	13.761.130,69	0,00	0,00	0,00
FTD	SP500 -%5				Likidite Senaryo				Likidite Senaryo			
	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-B	13.761.130,69	13.761.130,69	0,00	0,00	13.257.667,47	-503.463,22	-3,66	-4,60	13.504.267,63	-256.863,06	-1,87	-2,38
FTD	Likidite Senaryo											
	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)								
KRT-B	13.761.130,69	13.257.667,47	-503.463,22	-3,66								

FTD Fon Toplam Değeri, Amerikan Doları (USD) cinsindedir.

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

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 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;