

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Ekim-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	:	256.047.104,63
E-) Katılma Payı Sayısı	:	11.559.470,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	22,150419
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.191427
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	21,664983
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	1.169898
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,24
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	1.84
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	40,45
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	93,71
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	34,07
d-)Özel Sektör Tahvili	:	65,88
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
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

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	10.048,610000

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)	:	64.009,400000

**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)
<b>BORÇLANMA SENETLERİ</b>																			
<b>Eurobond Türk</b>																			
XS1711581337	USD	FIBABANK A	25/01/23	85	XS1711581337	4,33	2	1.000.000,00	100,674000	16/07/21	10,855460				100,523959	18.688.911,82	7,76	7,76	7,30
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	86	XS1747548532	5,86	2	900.000,00	102,156100	25/03/22	6,237483				101,460301	16.976.692,74	7,05	7,05	6,63
XS1496463297	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI AS	24/10/23	357	XS1496463297	6,05	2	1.300.000,00	101,416900	01/04/22	8,107501				97,698082	23.612.600,64	9,81	9,80	9,22
XS1003016018	USD	TİŞ BANKASI A.S.	11/12/23	405	XS1003016018	5,34	2	400.000,00	108,991700	01/12/21	7,597113				103,431479	7.691.785,40	3,20	3,19	3,00
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	440	XS1867595750	8,00	2	1.200.000,00	114,617800	01/04/22	10,411465				108,133479	24.124.363,00	10,02	10,02	9,42
XS1917720911	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI AS	24/01/24	449	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	9,969544				100,490671	3.736.544,63	1,55	1,55	1,46

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Ekim-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	T.İŞ BANKASI A.Ş.	25/04/24	541	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	9,264159				96,087685	3.572.828,39	1,48	1,48	1,40
XS1958649854	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/10/24	714	XS1958649854	4,43	2	770.000,00	112,827800	03/09/21	9,277168				98,892644	14.156.931,93	5,88	5,88	5,53
XS1686704948	USD	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	18/10/24	717	XS1686704948	4,51	2	400.000,00	101,047500	20/10/21	9,076029				92,401274	6.871.513,14	2,85	2,85	2,68
US900123CW86	USD	HAZİNE GARANTİ BANKASI	14/11/24	744	US900123CW86	6,59	2	3.000.000,00	101,964600	08/12/21	7,984325				98,448219	54.909.002,01	22,82	22,80	21,44
XS1617531063	USD	HAZİNE GARANTİ BANKASI	24/05/27	1665	XS1617531063	6,51	2	2.500.000,00	101,932600	16/03/22	11,285767				89,400082	41.552.040,70	17,26	17,25	16,23
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>11.870.000,00</b>							<b>215.893.214,40</b>	<b>89,68</b>	<b>89,63</b>	<b>84,31</b>	
<b>Eurobond Yabancı</b>																			
NO0010852643	USD	DNO ASA	29/05/24	575	NO0010852643	6,47	4	187.324,00	105,102500	31/05/22	8,902150				101,079548	3.520.230,85	1,46	1,46	1,37
NO0011002495	USD	HKN ENERGY LTD	26/05/25	937	NO0011002495	11,80	2	200.000,00	104,050700	14/03/22	13,504687				102,847521	3.824.179,36	1,59	1,59	1,49
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	1078	NO0010894330	7,94	2	600.000,00	105,901300	22/10/21	11,887923				94,764822	10.570.921,12	4,39	4,39	4,13
NO0011088593	USD	DNO ASA	09/09/26	1408	NO0011088593	7,78	4	200.000,00	102,187300	03/03/22	11,090274				92,390918	3.435.371,50	1,43	1,43	1,34
XS1706923148	USD	CREDIT EUROPE BANK	09/11/27	1834	XS1706923148	7,06	2	200.000,00	103,607800	17/09/21	9,971400				93,802027	3.487.840,78	1,45	1,45	1,36
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>1.387.324,00</b>							<b>24.838.543,61</b>	<b>10,32</b>	<b>10,32</b>	<b>9,69</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>13.257.324,00</b>							<b>240.731.758,01</b>	<b>100,00</b>	<b>99,95</b>	<b>94,00</b>	
<b>VIOP Nakit Teminatı</b>																			
VIOP Nakit Teminatı								131.877,43								131.877,43	100,00	0,05	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>131.877,43</b>							<b>131.877,43</b>	<b>100,00</b>	<b>0,05</b>		
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>131.877,43</b>							<b>131.877,43</b>	<b>100,00</b>	<b>0,05</b>		
<b>DİĞER</b>																			
<b>Döviz</b>																			
EUR	EUR	EU			EUR			45,95	18,640044	31/10/22					18,474200	848,89	0,00	0,00	0,00
USD	USD	FED			USD			880.100,15	18,187950	31/10/22					18,591500	16.362.381,94	0,00	0,00	6,39
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>880.146,10</b>							<b>16.363.230,83</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6,39</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>880.146,10</b>							<b>16.363.230,83</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6,39</b>	
<b>FON PORTFÖY DEĞERİ</b>																<b>240.863.635,44</b>		<b>100,00</b>	

**IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	240.863.635,44	94,07 %
B-)HAZIR DEĞERLER	16.364.092,02	6,39 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-1.180.622,83	-0,46 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
<b>FON TOPLAM DEĞERİ</b>	<b>256.047.104,63</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	221.164,43	0,0864 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	583,19	0,0002 %
Kayda Alma Ücreti	4.092,84	0,0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	32.137,03	0,0126 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	87,30	0,0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.893,57	0,0007 %
Diğer Harcamalar	74,21	0,0000 %
BİST KYD Ücreti	1.700,11	0,0007 %
E Defter Ücreti	271,44	0,0001 %
Kambiyo Vergi Tutari	1,86	0,0000 %
	262.005,98	0,1023 %

**VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELİZ 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 RISK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU\_EKİM 2022

## RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.10.2022

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.10.2022	02.11.2020	31.10.2022	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	13.772.267,15	837.630,55	6,08%	20,00%	709.703,77	5,15%	1,18	1.093.394,53	7,94%

## KALDIRAÇ RAPORU

31.10.2022

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-B	13.772.267,15	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80

## DUYARLILIK ANALİZİ

31.10.2022

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	13.772.267,15	13.772.267,15	0,00	0,00	0,00	13.772.267,15	0,00	0,00	0,00	13.772.267,15	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	13.772.267,15	13.740.276,06	-31.991,09	-0,23	-1,28	13.299.347,03	-472.920,11	-3,43	-4,62	13.772.267,15	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	13.772.267,15	13.772.267,15	0,00	0,00	0,00	13.299.347,03	-472.920,11	-3,43	-4,62	13.531.041,14	-241.226,00	-1,75	-2,39
FTD	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 (%)					
KRT-B	13.772.267,15	13.299.347,03	-472.920,11	-3,43	-4,62								

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

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

KRT-B Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz) Fon (USD)  
Karşılaştırma Ölçütü : %40 BIST-KYD EUROBOND USD + %40 BIST-KYD ÖSBA EUROBOND USD + %20 BIST-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;