

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Haziran-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	:	30.171.394,70
E-) Katılma Payı Sayısı	:	2.905.160,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	10,385450
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.196439
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	10,068577
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	1.184678
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,15
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	0,99
D-)Yılıbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	20,60
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	33,89
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	22,90
d-)Özel Sektör Tahvili	:	76,58
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	:	0,52
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

:	:	850,48
---	---	--------

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit

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

J-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit

Girişleri (USD)	:	159.099,520000
-----------------	---	----------------

K-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit

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

L-)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	564	XS1750996206	5,72	2	300.000,00	101,317000	12/11/20	0,000000				105,067301	2.736.047,09	9,69	9,64	9,07
XS1711581337	USD	FİBABANK A	25/01/23	573	XS1711581337	5,06	2	450.000,00	95,244000	19/03/21	0,000000				104,106384	4.066.535,89	14,42	14,34	13,48
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	574	XS1747548532	5,31	2	200.000,00	102,879000	12/11/20	0,000000				105,215863	1.826.610,51	6,47	6,44	6,05
XS1760780731	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/01/23	578	XS1760780731	4,02	2	200.000,00	103,567400	23/02/21	0,000000				105,573767	1.832.823,94	6,49	6,46	6,07
XS1496463297	USD	TURKIYE IHRACAT KREDIT BANKASI AS	24/10/23	845	XS1496463297	4,69	2	300.000,00	101,659700	28/04/21	0,000000				104,034644	2.709.155,76	9,59	9,55	8,98
XS1003016018	USD	T.IŞ BANKASI A.S.	11/12/23	893	XS1003016018	4,77	2	200.000,00	109,504600	19/02/21	0,000000				107,562137	1.867.343,24	6,61	6,58	6,19
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.	15/01/24	928	XS1867595750	8,13	2	200.000,00	115,186300	21/01/21	0,000000				121,851274	2.115.411,23	7,49	7,45	7,01

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Haziran-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)		
XS1917720911	USD	Ş. TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI	24/01/24	937	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	0,000000				112,418630	1.951.654,87	6,91	6,88	6,47		
XS1578203462	USD	AS T.İŞ BANKASI	25/04/24	1029	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	0,000000				105,465534	1.830.944,95	6,48	6,45	6,07		
XS1958649854	USD	A.S. YAPI VE KREDİ BANKASI	15/10/24	1202	XS1958649854	4,66	2	200.000,00	114,635400	10/02/21	0,000000				111,223808	1.930.912,04	6,84	6,80	6,40		
XS1617531063	USD	A.Ş. GARANTİ BANKASI	24/05/27	2153	XS1617531063	6,22	2	400.000,00	100,450800	21/01/21	0,000000				101,200890	3.513.816,36	12,44	12,38	11,65		
GRUP TOPLAMI								2.850.000,00								26.381.255,88	93,43	92,97	87,44		
Eurobond Yabancı																					
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	1566	NO0010894330	8,13	2	200.000,00	105,997400	19/03/21	0,000000				106,811370	1.854.309,47	6,57	6,53	6,15		
GRUP TOPLAMI								200.000,00									1.854.309,47	6,57	6,53	6,15	
GRUP TOPLAMI								3.050.000,00									28.235.565,35	100,00	99,50	93,59	
VIOP Nakit Teminatı																					
VIOP Nakit Teminatı								142.463,74									142.463,74	100,00	0,50		
GRUP TOPLAMI								142.463,74										142.463,74	100,00	0,50	
GRUP TOPLAMI								142.463,74									142.463,74	100,00	0,50		
DİĞER																					
Döviz																					
USD	USD	FED			USD			210.671,97	8,555352	30/06/21					8,680300	1.828.695,90	0,00	0,00	6,06		
GRUP TOPLAMI								210.671,97									1.828.695,90	0,00	0,00	6,06	
GRUP TOPLAMI								210.671,97									1.828.695,90	0,00	0,00	6,06	
FON PORTFÖY DEĞERİ																28.378.029,09		100,00			

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	28.378.029,09	94,06 %
B-)HAZIR DEĞERLER	1.829.139,47	6,06 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-35.773,86	-0,12 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	30.171.394,70	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	26.153,08	0,0867 %
Kayda Alma Ücreti	640,27	0,0021 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	9.012,49	0,0299 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	64,10	0,0002 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.121,24	0,0037 %
Diğer Harcamalar	413,00	0,0014 %
BİST KYD Ücreti	424,50	0,0014 %
	37.828,68	0,1254 %

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 LİMITLERİNE UYUM RAPORU_HAZİRAN 2021

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

30.06.2021

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örnekleme Sayısı	Eide Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
30.06.2021	02.07.2019	30.06.2021	Tarifsel_Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com

	Mutlak Risk		Görel Risk		2013_Yaz				
	FTD	RMD	RMD/FTD	Kistas RMD	Görel RMD	Görel RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD	
KRT-A	30.171.394,70	3.240.149,78	10,74%	2.513.569,19	8,33%	1,29	1,75	2.173.551,20	7,20%
KRT-B	3.475.847,00	214.265,70	6,16%	155.010,62	4,46%	1,38	1,75	212.318,29	6,11%

KALDIRAÇ RAPORU

30.06.2021

	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-A	30.171.394,70	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-
KRT-B	3.475.847,00	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-

DUYARLILIK ANALİZİ

30.06.2021

	Hisse -%10				Hisse -%20				USDTRY 10%				
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Port. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-A	30.171.394,70	30.171.394,70	0,00	0,00	30.171.394,70	0,00	0,00	0,00	34.006.337,79	12,71	12,71	10,00	10,00
KRT-B	3.475.847,00	3.475.847,00	0,00	0,00	3.475.847,00	0,00	0,00	0,00	3.475.847,00	0,00	0,00	0,00	0,00

	US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps				TL Gov 300 bps				
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Port. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)
KRT-A	30.171.394,70	30.077.328,13	-94.066,57	-0,31	28.819.758,76	-1.351.635,94	-4,48	-5,83	30.171.394,70	0,00	0,00	0,00	0,00
KRT-B	3.475.847,00	3.465.010,21	-10.836,79	-0,31	3.320.133,95	-155.713,04	-4,48	-5,83	3.475.847,00	0,00	0,00	0,00	0,00

	SP500 -%5				Likidite Senaryo			
	FTD	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Şok Sonrası Port. (TRY)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)	Port. Değişim (%)
KRT-A	30.171.394,70	30.171.394,70	0,00	0,00	28.079.802,86	-2.091.591,84	-6,93	-7,71
KRT-B	3.475.847,00	3.475.847,00	0,00	0,00	3.320.133,95	-155.713,04	-4,48	-5,83

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

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;