

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Ocak-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	:	161.313.184,09
E-) Katılma Payı Sayısı	:	10.001.716,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	16,128551
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.203488
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	15,771020
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	1.183211
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	2,27
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	1.71
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	2,27
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	88,49
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	32,80
d-)Özel Sektör Tahvili	:	67,16
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	:	0,04
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

	:	898,76
--	---	--------

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)

	:	0,00
--	---	------

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)

	:	99.380,730000
--	---	---------------

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)

	:	0,00
--	---	------

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)

	:	233.179,910000
--	---	----------------

**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	358	XS1711581337	4,33	2	1.000.000,00	100,674000	16/07/21	0,000000				100,237630	13.433.346,00	8,62	8,62	8,33
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	359	XS1747548532	4,38	2	500.000,00	103,110600	27/10/21	0,000000				100,427479	6.729.394,33	4,32	4,32	4,17
US900123CA66	USD	HAZİNE	23/03/23	415	US900123CA66	4,78	2	300.000,00	98,856300	14/12/21	0,000000				100,426534	4.037.598,60	2,59	2,59	2,50
XS1496463297	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI A.Ş.	24/10/23	630	XS1496463297	4,69	2	300.000,00	101,659700	28/04/21	0,000000				101,125877	4.065.715,31	2,61	2,61	2,52
XS1003016018	USD	T.İŞ BANKASI A.S.	11/12/23	678	XS1003016018	5,34	2	400.000,00	108,991700	01/12/21	0,000000				103,806356	5.564.643,53	3,57	3,57	3,45
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	713	XS1867595750	8,42	2	700.000,00	116,145500	07/01/22	0,000000				111,293219	10.440.472,54	6,70	6,70	6,47
XS1917720911	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ	24/01/24	722	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	0,000000				104,016219	2.787.946,72	1,79	1,79	1,73

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Ocak-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	814	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	0,000000				101,683521	2.725.423,40	1,75	1,75	1,69
XS1958649854	USD	A.S. YAPI VE KREDİ BANKASI	15/10/24	987	XS1958649854	4,43	2	770.000,00	112,827800	03/09/21	0,000000				107,205096	11.062.660,01	7,10	7,10	6,86
XS1686704948	USD	A.S. TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİL ERİ A.Ş.	18/10/24	990	XS1686704948	4,51	2	400.000,00	101,047500	20/10/21	0,000000				99,608521	5.339.614,35	3,43	3,43	3,31
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24	1017	US900123CW86	6,59	2	3.000.000,00	101,964600	08/12/21	0,000000				99,997712	40.203.580,25	25,78	25,76	24,92
XS1584113184	USD	T.SINAI KALKINMA BANKASI	29/03/27	1882	XS1584113184	7,82	2	500.000,00	102,626500	09/12/21	0,000000				102,642411	6.877.811,35	4,41	4,41	4,26
XS1617531063	USD	A.Ş. GARANTI BANKASI	24/05/27	1938	XS1617531063	6,34	2	1.900.000,00	102,478000	06/12/21	0,000000				100,811096	25.669.378,13	16,47	16,47	15,91
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>10.170.000,00</b>								<b>138.937.584,52</b>	<b>89,14</b>	<b>89,12</b>	<b>86,12</b>
<b>Eurobond Yabancı</b>																			
NO0010852643	USD	DNO ASA	29/05/24	848	NO0010852643	6,47	4	400.000,00	105,102500	22/10/21	0,000000				105,532548	5.657.177,77	3,63	3,63	3,51
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV CREDIT EUROPE BANK	14/10/25	1351	NO0010894330	7,94	2	600.000,00	105,901300	22/10/21	0,000000				106,585329	8.570.419,70	5,50	5,50	5,31
XS1706923148	USD	FIN IV CREDIT EUROPE BANK	09/11/27	2107	XS1706923148	7,06	2	200.000,00	103,607800	17/09/21	0,000000				100,540630	2.694.790,51	1,73	1,73	1,67
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>1.200.000,00</b>								<b>16.922.387,98</b>	<b>10,86</b>	<b>10,86</b>	<b>10,49</b>
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>11.370.000,00</b>								<b>155.859.972,50</b>	<b>100,00</b>	<b>99,98</b>	<b>96,61</b>
<b>VIOP Nakit Teminatı</b>																			
VIOP Nakit Teminatı								26.984,71								26.984,71	100,00	0,02	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>26.984,71</b>								<b>26.984,71</b>	<b>100,00</b>	<b>0,02</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>26.984,71</b>							<b>26.984,71</b>	<b>100,00</b>	<b>0,02</b>		
<b>DİĞER</b>																			
<b>Döviz</b>																			
USD	USD	FED			USD			618.054,84	13,650561	31/01/22					13,401500	8.282.861,94	0,00	0,00	5,13
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>618.054,84</b>								<b>8.282.861,94</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>5,13</b>
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>618.054,84</b>								<b>8.282.861,94</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>5,13</b>
FON PORTFÖY DEĞERİ																<b>155.886.957,21</b>		<b>100,00</b>	

**IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	155.886.957,21	96,64 %
B-)HAZIR DEĞERLER	8.283.936,41	5,14 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-2.857.709,53	-1,77 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	161.313.184,09	100,00 %

**V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	152.134,20	0,0943 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	572,72	0,0004 %
Kayda Alma Ücreti	2.642,88	0,0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	25.493,81	0,0158 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	87,30	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.258,98	0,0008 %
Diğer Harcamalar	149,22	0,0001 %
BİST KYD Ücreti	438,65	0,0003 %
E Defter Ücreti	261,87	0,0002 %
	183.039,63	0,1136 %

**VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ 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\_OCAK 2022

## RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.01.2022

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.01.2022	31.01.2020	31.01.2022	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 (USD)	12.036.949,90	975.122,40	8,10%	20,00%	671.803,29	5,58%	1,45	1.034.005,39	8,59%

## KALDIRAÇ RAPORU

31.01.2022

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-B (USD)	12.036.949,90	-	0,00	0,90	0,00	0,80	-

## DUYARLILIK ANALİZİ

31.01.2022

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 (USD)	12.036.949,90	12.036.949,90	0,00	0,00	12.036.949,90	0,00	0,00	0,00	12.036.949,90	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 (USD)	12.036.949,90	12.006.290,73	-30.659,17	-0,25	11.524.193,03	-512.756,87	-4,26	-5,22	12.036.949,90	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 (USD)	12.036.949,90	12.036.949,90	0,00	0,00	11.524.193,03	-512.756,87	-4,26	-5,22	11.774.921,71	-262.028,19	-2,18	-2,71
FTD	Likidite Senaryo											
	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)								
KRT-B (USD)	12.036.949,90	11.524.193,03	-512.756,87	-4,26	-5,22							

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;