

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Ağustos-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	:	251.161.485,26
E-) Katılma Payı Sayısı	:	11.838.108,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	21,216354
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.167633
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	20,430015
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	1.141731
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	3,85
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	2.27
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	34,53
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	111,02
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	37,37
d-)Özel Sektör Tahvili	:	62,60
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	:	0,03
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)	:	238.966,620000

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)	:	479.931,970000

**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	146	XS1711581337	4,33	2	1.000.000,00	100,674000	16/07/21	12,743521				98,142219	17.832.833,79	7,28	7,28	7,10
XS1747548532	USD	PETKİM PETROKİM YA HOLDİNG A.Ş.	26/01/23	147	XS1747548532	5,86	2	900.000,00	102,156100	25/03/22	6,498265				100,342452	16.409.362,42	6,70	6,70	6,53
XS1496463297	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI AS	24/10/23	418	XS1496463297	6,05	2	1.300.000,00	101,416900	01/04/22	9,351385				97,842658	23.111.922,92	9,44	9,44	9,20
XS1003016018	USD	T.IŞ BANKASI A.S.	11/12/23	466	XS1003016018	5,34	2	400.000,00	108,991700	01/12/21	9,663004				99,825562	7.255.481,54	2,96	2,96	2,89
US900123CR91	USD	HAZİNE	25/12/23	480	US900123CR91	5,89	2	700.000,00	104,637500	29/04/22	7,133913				101,593548	12.921.967,83	5,28	5,28	5,14
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	501	XS1867595750	8,00	2	1.200.000,00	114,617800	01/04/22	10,711408				105,993644	23.111.362,87	9,44	9,44	9,20
XS1917720911	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ	24/01/24	510	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	10,681206				98,059904	3.563.575,36	1,46	1,46	1,42

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Ağustos-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	602	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	9,887594				96,835945	3.519.095,72	1,44	1,44	1,40
XS1958649854	USD	A.S. YAPI VE KREDİ BANKASI	15/10/24	775	XS1958649854	4,43	2	770.000,00	112,827800	03/09/21	9,264070				101,544178	14.207.257,17	5,80	5,80	5,66
XS1686704948	USD	A.S. TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİL ERİ A.Ş.	18/10/24	778	XS1686704948	4,51	2	400.000,00	101,047500	20/10/21	9,069502				93,308384	6.781.802,61	2,77	2,77	2,70
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24	805	US900123CW86	6,59	2	3.000.000,00	101,964600	08/12/21	9,697685				94,083329	51.285.951,51	20,95	20,94	20,42
XS1617531063	USD	GARANTİ BANKASI	24/05/27	1726	XS1617531063	6,51	2	2.500.000,00	101,932600	16/03/22	11,387575				87,503638	39.749.402,76	16,23	16,23	15,83
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>12.570.000,00</b>							<b>219.750.016,50</b>	<b>89,75</b>	<b>89,74</b>	<b>87,49</b>	
<b>Eurobond Yabancı</b>																			
NO0010852643	USD	DNO ASA	29/05/24	636	NO0010852643	6,47	4	187.324,00	105,102500	31/05/22	8,533677				100,204890	3.410.725,97	1,39	1,39	1,36
NO0011002495	USD	HKN ENERGY LTD	26/05/25	998	NO0011002495	11,80	2	200.000,00	104,050700	14/03/22	13,200909				101,326041	3.682.269,39	1,50	1,50	1,47
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	1139	NO0010894330	7,94	2	600.000,00	105,901300	22/10/21	10,553247				100,752603	10.984.290,56	4,49	4,48	4,37
NO0011088593	USD	DNO ASA	09/09/26	1469	NO0011088593	7,78	4	200.000,00	102,187300	03/03/22	9,606695				97,084753	3.528.137,61	1,44	1,44	1,40
XS1706923148	USD	CREDIT EUROPE BANK	09/11/27	1895	XS1706923148	7,06	2	200.000,00	103,607800	17/09/21	8,890648				96,305384	3.499.814,68	1,43	1,43	1,39
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>1.387.324,00</b>							<b>25.105.238,21</b>	<b>10,25</b>	<b>10,24</b>	<b>9,99</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>13.957.324,00</b>							<b>244.855.254,71</b>	<b>100,00</b>	<b>99,98</b>	<b>97,48</b>	
<b>VIOP Nakit Teminatı</b>																			
VIOP Nakit Teminatı								45.632,31							45.632,31	100,00	0,02		
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>45.632,31</b>							<b>45.632,31</b>	<b>100,00</b>	<b>0,02</b>		
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>45.632,31</b>							<b>45.632,31</b>	<b>100,00</b>	<b>0,02</b>		
<b>DİĞER</b>																			
<b>Döviz</b>																			
USD	USD	FED			USD			359.263,38	17,522731	31/08/22				18,170400	6.527.959,32	0,00	0,00	2,60	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>359.263,38</b>							<b>6.527.959,32</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2,60</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>359.263,38</b>							<b>6.527.959,32</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2,60</b>	
FON PORTFÖY DEĞERİ																<b>244.900.887,02</b>		<b>100,00</b>	

**IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	244.900.887,02	97,51 %
B-)HAZIR DEĞERLER	6.529.263,80	2,60 %
C-)ALACAKLAR	0,00	0,00 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-268.665,56	-0,11 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	251.161.485,26	100,00 %

**V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	229.880,56	0,0915 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	623,41	0,0002 %
Kayda Alma Ücreti	4.247,36	0,0017 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	32.441,37	0,0129 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	223,30	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	1.436,23	0,0006 %
Diğer Harcamalar	0,18	0,0000 %
BİST KYD Ücreti	849,40	0,0003 %
E Defter Ücreti	290,16	0,0001 %
	269.991,97	0,1074 %

**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 RISK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU\_AĞUSTOS 2022

## RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

31.08.2022

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.08.2022	01.09.2020	31.08.2022	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	13.822.562,26	984.537,74	7,12%	20,00%	743.063,89	5,38%	1,32	1.253.429,73	9,07%

## KALDIRAÇ RAPORU

31.08.2022

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-B	13.822.562,26	-	-	0,00	0,90	0,00	0,80

## DUYARLILIK ANALİZİ

31.08.2022

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	13.822.562,26	13.822.562,26	0,00	0,00	13.822.562,26	0,00	0,00	0,00	13.822.562,26	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	13.822.562,26	13.789.513,59	-33.048,67	-0,24	13.324.374,92	-498.187,34	-3,60	-4,49	13.822.562,26	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	13.822.562,26	13.822.562,26	0,00	0,00	13.324.374,92	-498.187,34	-3,60	-4,49	13.568.434,97	-254.127,29	-1,84	-2,32
FTD	Likidite Senaryo											
	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)								
KRT-B	13.822.562,26	13.324.374,92	-498.187,34	-3,60								

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;