

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Şubat-2023**

**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	:	263.827.610,38
E-) Katılma Payı Sayısı	:	11.375.361,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	02 Kasım 2018
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

**II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	23,192900
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	1.229434
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	23,160959
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	1.232766
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	0,14
Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	-0.27
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	0,71
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	39,46
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri	:	
a-)Hisse Senedi	:	0,00
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	40,97
d-)Özel Sektör Tahvili	:	58,87
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	:	0,16
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 : 469,51

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

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD) : 3.211,450000

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

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD) : 55.351,000000

**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>																			
XS1496463297	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI A.S	24/10/23	237	XS1496463297	6,05	2	1.100.000,00	101,416900	27/02/23	6,878924				100,965205	20.951.461,43	8,26	8,25	7,94
XS1003016018	USD	T.İŞ BANKASI A.S.	11/12/23	285	XS1003016018	5,34	2	400.000,00	108,991700	01/12/21	7,650310				101,917548	7.690.575,87	3,03	3,03	2,92
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	320	XS1867595750	7,73	2	1.400.000,00	114,288500	28/12/22	9,500283				105,422603	27.842.720,83	10,98	10,96	10,55
XS1917720911	USD	TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI A.S.	24/01/24	329	XS1917720911	4,61	2	200.000,00	110,643800	03/03/21	9,114742				100,198096	3.780.414,04	1,49	1,49	1,43
XS1578203462	USD	T.İŞ BANKASI A.S.	25/04/24	421	XS1578203462	4,63	2	200.000,00	106,152400	17/03/21	8,663094				99,528384	3.755.146,19	1,48	1,48	1,42
XS1958649854	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/10/24	594	XS1958649854	4,43	2	770.000,00	112,827800	03/09/21	8,646402				102,706973	14.919.028,94	5,88	5,87	5,65

**KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon**  
**Şubat-2023**

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRACÇI 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)
XS1686704948	USD	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	18/10/24	597	XS1686704948	4,51	2	400.000,00	101,047500	20/10/21	7,913202				96,684726	7.295.713,40	2,88	2,87	2,77
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24	624	US900123CW86	6,59	2	3.000.000,00	101,964600	08/12/21	8,546650				97,269301	55.048.685,69	21,69	21,66	20,87
XS2395576437	USD	TURKIYE IHRACAT KREDİT BANKASI AS	31/01/26	1067	XS2395576437	9,27	2	500.000,00	100,276000	01/02/23	10,169682				99,325178	9.368.698,43	3,69	3,69	3,55
XS2581381634	USD	TC ZIRAAT BANKASI	03/08/26	1251	XS2581381634	9,76	2	1.000.000,00	99,268300	01/02/23	10,173750				99,441740	18.759.385,87	7,40	7,38	7,11
XS1617531063	USD	GARANTİ BANKASI	24/05/27	1545	XS1617531063	6,51	2	2.500.000,00	101,932600	16/03/22	10,152829				92,584649	43.664.540,85	17,21	17,19	16,55
XS1386178237	USD	FİBANK A.Ş.	24/11/27	1729	XS1386178237	9,28	2	200.000,00	97,375200	16/02/23	9,207225				97,660052	3.684.655,17	1,45	1,45	1,40
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>11.670.000,00</b>								<b>216.761.026,71</b>	<b>85,44</b>	<b>85,32</b>	<b>82,16</b>
<b>Eurobond Yabancı</b>																			
XS1953055875	USD	ARAB REPUBLIC OF EGYPT	01/03/24	366	XS1953055875	9,34	2	500.000,00	99,403500	01/02/23	9,883928				99,805732	9.414.025,92	3,71	3,71	3,57
NO0010852643	USD	DNO ASA	29/05/24	455	NO0010852643	6,47	4	187.324,00	105,102500	31/05/22	8,268273				100,421000	3.548.688,41	1,40	1,40	1,35
NO0011002495	USD	HKN ENERGY LTD	26/05/25	817	NO0011002495	12,68	2	500.000,00	104,034200	10/11/22	13,369673				101,259411	9.551.142,05	3,77	3,76	3,62
NO0010894330	USD	GENEL ENERGY FIN IV	14/10/25	958	NO0010894330	7,94	2	600.000,00	105,901300	22/10/21	11,524922				99,068918	11.213.432,48	4,42	4,41	4,25
NO0011088593	USD	DNO ASA	09/09/26	1288	NO0011088593	9,95	4	500.000,00	97,945800	23/11/22	9,913638				96,709603	9.121.988,21	3,60	3,59	3,46
XS1706923148	USD	CREDIT EUROPE BANK	09/11/27	1714	XS1706923148	7,06	2	200.000,00	103,607800	17/09/21	12,194647				95,100318	3.588.077,93	1,41	1,41	1,36
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>2.487.324,00</b>								<b>46.437.355,00</b>	<b>18,31</b>	<b>18,28</b>	<b>17,61</b>
<b>Eurobond Türk</b>																			
XS1496463297	USD	TURKIYE IHRACAT KREDİT BANKASI AS	24/10/23	237	XS1496463297	6,80	2	-500.000,00	100,996180	01/03/23					100,965205	-9.523.391,55	-3,75	-3,75	-3,61
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>-500.000,00</b>								<b>-9.523.391,55</b>	<b>-3,75</b>	<b>-3,75</b>	<b>-3,61</b>
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>13.657.324,00</b>								<b>253.674.990,16</b>	<b>100,00</b>	<b>99,85</b>	<b>96,16</b>
<b>VIOP Nakit Teminatı</b>																			
VIOP Nakit Teminatı								387.366,05								387.366,05	100,00	0,15	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>387.366,05</b>								<b>387.366,05</b>	<b>100,00</b>	<b>0,15</b>	
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>387.366,05</b>								<b>387.366,05</b>	<b>100,00</b>	<b>0,15</b>	
<b>DİĞER</b>																			
<b>Döviz</b>																			
EUR	EUR	EU			EUR			45,95	18,640044	28/02/23					20,004200	919,19	0,00	0,00	0,00
USD	USD	FED			USD			26.803,00	18,797370	28/02/23					18,864700	505.630,56	0,00	0,00	0,19
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>26.848,95</b>								<b>506.549,75</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,19</b>
<b>GRUP TOPLAMI</b>								<b>26.848,95</b>								<b>506.549,75</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,19</b>
<b>FON PORTFÖY DEĞERİ</b>																<b>254.062.356,21</b>		<b>100,00</b>	

**IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU**

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	254.062.356,21	96,30 %
B-)HAZIR DEĞERLER	509.100,62	0,19 %
C-)ALACAKLAR	9.526.313,18	3,61 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-270.159,63	-0,10 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
<b>FON TOPLAM DEĞERİ</b>	<b>263.827.610,38</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	221.599,79	0,0840 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	1.522,49	0,0006 %
Kayda Alma Ücreti	4.104,82	0,0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	35.678,69	0,0135 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	194,60	0,0001 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	2.342,24	0,0009 %
BİST KYD Ücreti	1.141,56	0,0004 %
E Defter Ücreti	466,48	0,0002 %
Kambiyo Vergi Tutarı	64,32	0,0000 %
	<b>267.114,99</b>	<b>0,1013 %</b>

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon  
Şubat-2023

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ 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 RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU\_SUBAT 2023

## RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

28.02.2023

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
28.02.2023	03.03.2021	28.02.2023	Tarihsel_Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	market@riskturk.com

Mutlak Risk				Görel Risk				2013_Yaz	
FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kistas RMD	Kistas RMD/FTD	Görel RMD	Görel RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
KRT-B	13,985,253.43	1,032,138.98	7.38%	20.00%	697,433.29	4.99%	1.48	1,346,594.99	9.63%

## KALDIRAÇ RAPORU

28.02.2023

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRT-B	13,985,253.43	-	-	0.00	0.90	0.00	0.80

## DUYARLILIK ANALİZİ

28.02.2023

		Hisse -%10				Hisse -%20				USDTRY 10%			
FTD	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	13,985,253.43	13,985,253.43	0.00	0.00	13,985,253.43	0.00	0.00	0.00	13,985,253.43	0.00	0.00	0.00	
		US Gov 10yr 100 bps				US Gov 200 bps				TL Gov 300 bps			
FTD	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	13,985,253.43	13,937,058.12	-48,195.31	-0.34	-1.28	13,434,646.24	-550,607.19	-3.94	-4.46	13,985,253.43	0.00	0.00	0.00
		SP500 -%5				Likidite Senaryo				Likidite Senaryo			
FTD	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	13,985,253.43	13,985,253.43	0.00	0.00	13,434,646.24	-550,607.19	-3.94	-4.46	13,704,559.50	-280,693.93	-2.01	-2.31	
		Likidite Senaryo											
FTD	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)									
KRT-B	13,985,253.43	13,434,646.24	-550,607.19	-3.94	-4.46								

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 endeksinde aşağı yönlü 5% şok

Likidite Senaryo Eşzamanlı olarak;