

KRT-Kare Portföy Türkiye Odaklı Serbest (Döviz)Fon
Haziran-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 | : | 350.040.409,08 |
| E-) Katılma Payı Sayısı | : | 10.760.286,000 |
| F-)Fonun Kuruluş Tarihi | : | 02 Kasım 2018 |
| G-)Fonun Süresi | : | Süresizdir. |

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

| | | |
|--|---|-----------|
| A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL) | : | 32,530772 |
| Ay Sonu Pay Fiyatı (USD) | : | 1.259755 |
| B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL) | : | 25,407164 |
| Önceki Ay Pay Fiyat (USD) | : | 1.229585 |
| C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL) | : | 28,04 |
| Aylık Pay Fiyat Art Oran (USD) | : | 2.45 |
| D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı | : | 41,25 |
| E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı | : | 71,08 |
| F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdeleri | : | |
| a-)Hisse Senedi | : | 0,00 |
| b-)Hazine Bonosu | : | 0,00 |
| c-)Devlet Tahvili | : | 45,00 |
| d-)Özel Sektör Tahvili | : | 54,96 |
| 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

| | | |
|---|---|----------------|
| I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL) | : | 0,00 |
| I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD) | : | 291.409,020000 |

| | | |
|--|---|---------------|
| İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL) | : | 0,00 |
| İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD) | : | 52.792,540000 |

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) |
|----------------------------|-------------|--|-------------|------------------|--------------|--------------------|-------------------|---------------|-------------------|-------------------|----------------------|---------------------|-------------------|------------------|-----------------|---------------|----------|-------------------|-------------------|
| BORÇLANMA SENETLERİ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Eurobond Türk | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| XS1867595750 | USD | YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş. | 15/01/24 | 196 | XS1867595750 | 7,73 | 2 | 1.400.000,00 | 114,288500 | 28/12/22 | 10,472798 | | | | 108,136301 | 39.093.803,33 | 11,67 | 11,67 | 11,17 |
| XS1917720911 | USD | TURKIYE İHRACAT KREDİ BANKASI AS | 24/01/24 | 205 | XS1917720911 | 4,61 | 2 | 200.000,00 | 110,643800 | 03/03/21 | 8,652115 | | | | 103,372836 | 5.338.814,14 | 1,59 | 1,59 | 1,53 |
| US900123CF53 | USD | HAZİNE | 22/03/24 | 263 | US900123CF53 | 7,52 | 2 | 500.000,00 | 99,952800 | 12/06/23 | 7,924271 | | | | 100,082849 | 12.922.247,13 | 3,86 | 3,86 | 3,69 |
| XS1578203462 | USD | T.İŞ BANKASI A.S. | 25/04/24 | 297 | XS1578203462 | 7,11 | 2 | 500.000,00 | 103,667200 | 19/04/23 | 8,348399 | | | | 99,427096 | 12.837.579,20 | 3,83 | 3,83 | 3,67 |
| XS1958649854 | USD | YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş. | 15/10/24 | 470 | XS1958649854 | 4,43 | 2 | 770.000,00 | 112,827800 | 03/09/21 | 8,808470 | | | | 101,180014 | 20.118.418,41 | 6,01 | 6,00 | 5,75 |
| XS1686704948 | USD | TÜPRAŞ-TURKIYE PETROL RAFİNERİL ERI A.Ş. | 18/10/24 | 473 | XS1686704948 | 4,51 | 2 | 400.000,00 | 101,047500 | 20/10/21 | 8,094323 | | | | 96,659658 | 9.984.208,01 | 2,98 | 2,98 | 2,85 |
| US900123CW86 | USD | HAZİNE | 14/11/24 | 500 | US900123CW86 | 6,85 | 2 | 3.800.000,00 | 101,617000 | 05/04/23 | 8,335882 | | | | 97,367781 | 95.544.841,75 | 28,54 | 28,53 | 27,30 |

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

| 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) |
|----------------------------|-------------|-----------------------------------|-------------|------------------|--------------|--------------------|-------------------|----------------------|-------------------|-------------------|----------------------|---------------------|-------------------|------------------|-----------------------|-----------------------|--------------|-------------------|-------------------|
| XS2395576437 | USD | TURKIYE IHRACAT KREDIT BANKASI AS | 31/01/26 | 943 | XS2395576437 | 9,27 | 2 | 500.000,00 | 100,276000 | 01/02/23 | 9,701735 | | | | 103,555110 | 13.370.569,75 | 3,99 | 3,99 | 3,82 |
| XS2581381634 | USD | TC ZIRAAT BANKASI | 03/08/26 | 1127 | XS2581381634 | 9,76 | 2 | 1.000.000,00 | 99,268300 | 01/02/23 | 9,868103 | | | | 103,438137 | 26.710.933,55 | 7,98 | 7,97 | 7,63 |
| XS1617531063 | USD | GARANTI BANKASI | 24/05/27 | 1421 | XS1617531063 | 6,51 | 2 | 1.500.000,00 | 101,932600 | 28/03/23 | 9,883964 | | | | 92,745858 | 35.924.783,30 | 10,73 | 10,72 | 10,26 |
| XS1386178237 | USD | FIBABANK A.A.Ş. | 24/11/27 | 1605 | XS1386178237 | 9,28 | 2 | 200.000,00 | 97,375200 | 16/02/23 | 303,385445 | | | | 96,684110 | 4.993.366,86 | 1,49 | 1,49 | 1,43 |
| GRUP TOPLAMI | | | | | | | | 10.770.000,00 | | | | | | | 276.839.565,43 | 82,67 | 82,63 | 79,10 | |
| Eurobond Yabancı | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| XS1953055875 | USD | ARAB REPUBLIC OF EGYPT | 01/03/24 | 242 | XS1953055875 | 9,34 | 2 | 500.000,00 | 99,403500 | 01/02/23 | 14,881241 | | | | 96,872450 | 12.507.734,80 | 3,73 | 3,73 | 3,57 |
| NO0010852643 | USD | DNO ASA | 29/05/24 | 331 | NO0010852643 | 6,47 | 4 | 187.324,00 | 105,102500 | 31/05/22 | 8,409429 | | | | 100,920137 | 4.881.796,05 | 1,46 | 1,46 | 1,39 |
| NO0011002495 | USD | HKN ENERGY LTD | 26/05/25 | 693 | NO0011002495 | 12,68 | 2 | 500.000,00 | 104,034200 | 10/11/22 | 14,193836 | | | | 98,169438 | 12.675.196,12 | 3,78 | 3,78 | 3,62 |
| NO0010894330 | USD | GENEL ENERGY FIN IV | 14/10/25 | 834 | NO0010894330 | 7,94 | 2 | 450.000,00 | 105,901300 | 08/03/23 | 12,222484 | | | | 96,663055 | 11.232.628,79 | 3,35 | 3,35 | 3,21 |
| NO0011088593 | USD | DNO ASA | 09/09/26 | 1164 | NO0011088593 | 9,95 | 4 | 500.000,00 | 97,945800 | 23/11/22 | 10,798311 | | | | 93,577233 | 12.082.271,21 | 3,61 | 3,61 | 3,45 |
| XS1706923148 | USD | CREDIT EUROPE BANK | 09/11/27 | 1590 | XS1706923148 | 7,06 | 2 | 200.000,00 | 103,607800 | 17/09/21 | 13,211620 | | | | 90,914641 | 4.695.395,74 | 1,40 | 1,40 | 1,34 |
| GRUP TOPLAMI | | | | | | | | 2.337.324,00 | | | | | | | 58.075.022,71 | 17,33 | 17,33 | 16,58 | |
| GRUP TOPLAMI | | | | | | | | 13.107.324,00 | | | | | | | 334.914.588,14 | 100,00 | 99,96 | 95,68 | |
| VIOP Nakit Teminatı | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| VIOP Nakit Teminatı | | | | | | | | 123.678,97 | | | | | | | | 123.678,97 | 100,00 | 0,04 | |
| GRUP TOPLAMI | | | | | | | | 123.678,97 | | | | | | | 123.678,97 | 100,00 | 0,04 | | |
| GRUP TOPLAMI | | | | | | | | 123.678,97 | | | | | | | 123.678,97 | 100,00 | 0,04 | | |
| DİĞER | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Döviz | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| EUR | EUR | EU | | | EUR | 45,95 | | 18,640044 | 27/06/23 | | | | | | 28,154000 | 1.293,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| USD | USD | FED | | | USD | 606.614,21 | | 22,350666 | 27/06/23 | | | | | | 25,823100 | 15.664.659,41 | 0,00 | 0,00 | 4,48 |
| GRUP TOPLAMI | | | | | | | | 606.660,16 | | | | | | | 15.665.953,09 | 0,00 | 0,00 | 4,48 | |
| GRUP TOPLAMI | | | | | | | | 606.660,16 | | | | | | | 15.665.953,09 | 0,00 | 0,00 | 4,48 | |
| FON PORTFÖY DEĞERİ | | | | | | | | | | | | | | | | 335.038.267,11 | | 100,00 | |

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

| AÇIKLAMA | TUTAR | ORAN% |
|-----------------------|----------------|----------|
| A-)FON PORTFÖY DEĞERİ | 335.038.267,11 | 95,71 % |
| B-)HAZIR DEĞERLER | 15.420.039,49 | 4,41 % |
| C-)ALACAKLAR | 0,00 | 0,00 % |
| D-)DİĞER VARLIKLAR | 0,00 | 0,00 % |
| E-)BORÇLAR | -417.897,52 | -0,12 % |
| F-)İHTİYAT | 0,00 | 0,00 % |
| G-)VERGİ | 0,00 | 0,00 % |
| FON TOPLAM DEĞERİ | 350.040.409,08 | 100,00 % |

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| AÇIKLAMA | TUTAR | ORAN% |
|--|------------|----------|
| Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar | 0,00 | 0,0000 % |
| Fon Yönetim Ücreti | 304.411,85 | 0,0870 % |
| Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri | 1.152,96 | 0,0003 % |
| Kayda Alma Ücreti | 9.132,15 | 0,0026 % |
| Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler | 41.994,70 | 0,0120 % |
| Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri | 194,60 | 0,0001 % |
| Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti | 3.486,08 | 0,0010 % |
| BİST KYD Ücreti | 1.302,40 | 0,0004 % |
| E Defter Ücreti | 533,12 | 0,0002 % |
| | 362.207,86 | 0,1036 % |

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELİZ 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

*** Kaldıraç ve risk limitlerine uyum raporu EK'tedir.

KARE PORTFÖY TÜRKİYE ODAKLI SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_HAZİRAN 2023

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

27.06.2023

| Portföy Tarihi | Başlangıç Tarihi | Bitiş Tarihi | Hesaplama Tipi | Güven Aralığı | Volatilite Methodu | Örneklem Sayısı | Elde Tutma Periyodu | Yazılım | Mail Adresi | |
|----------------|------------------|--------------|--------------------|---------------|--------------------|-----------------|---------------------|-----------|---------------------|-------|
| 27.06.2023 | 01.07.2021 | 27.06.2023 | 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 | 13.555.320,98 | 885.390,99 | 6,53% | 20,00% | 671.574,97 | 4,95% | 1,32 | 1,75 | 1.032.890,15 | 7,62% |

KALDIRAÇ RAPORU

27.06.2023

| FTD | Kaldıraç | Açık Pozisyon | Kaldıraç / FTD | Kaldıraç / FTD Limit | Açık Pozisyon / FTD | Açık Pozisyon / FTD Limit | Kaldıraç İşlem RMD |
|-------|---------------|---------------|----------------|----------------------|---------------------|---------------------------|--------------------|
| KRT-B | 13.555.320,98 | - | - | 0,00 | 0,90 | 0,00 | 0,80 |

DUYARLILIK ANALİZİ

27.06.2023

| 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 | 13.555.320,98 | 13.555.320,98 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.555.320,98 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.555.320,98 | 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 | 13.555.320,98 | 13.512.454,42 | -42.866,56 | -0,32 | -1,27 | 13.095.657,17 | -459.663,80 | -3,39 | -4,49 | 13.555.320,98 | 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 | 13.555.320,98 | 13.555.320,98 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.095.657,17 | -459.663,80 | -3,39 | -4,49 | 13.321.310,62 | -234.010,35 | -1,73 | -2,33 |
| Likidite Senaryo | | | | | | | | | | | | | |
| FTD | Şok Sonrası Port. (USD) | Port. Değişim (USD) | Port. Değişim (%) | Bench. Değişim (%) | | | | | | | | | |
| KRT-B | 13.555.320,98 | 13.095.657,17 | -459.663,80 | -3,39 | -4,49 | | | | | | | | |

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;