

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon
Temmuz-2022

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-)Fonun Adı	:	KRS-Kare Portföy 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	:	225.628.660,35
E-) Katılma Payı Sayısı	:	1.573.102.167,000
F-)Fonun Kuruluş Tarihi	:	05 Mart 2012
G-)Fonun Süresi	:	Süresizdir.

II-FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A-)Ay Sonu Pay Fiyatı (TL)	:	0,143429
Ay Sonu Pay Fiyatı (USD)	:	0.008016
B-)Önceki Ay Pay Fiyatı (TL)	:	0,122687
Önceki Ay Pay Fiyat (USD)	:	0.007364
C-)Aylık Pay Fiyatı Artış Oranı (TL)	:	16,91
Aylk Pay Fiyat Art Oran (USD)	:	8.85
D-)Yılbaşına Göre Fiyat Artış Oranı	:	10,27
E-)Yıllık Pay Fiyatı Artış Oranı	:	82,69
F-)Aylık Ortalama Portföydeki Menkul Kıymetler Yüzdesi		
a-)Hisse Senedi	:	67,62
b-)Hazine Bonosu	:	0,00
c-)Devlet Tahvili	:	8,69
d-)Özel Sektör Tahvili	:	11,00
e-)Kira Sertifikaları	:	0,00
f-)Finansman Bonusu	:	0,00
g-)TPP-TPP Borçlanma	:	0,00
h-)Opsiyon	:	-3,63
i-) Varant	:	0,00
j-)Değerli Maden	:	0,00
k-)Mevduat	:	0,00
l-) Katılım Hesabı	:	0,00
m-)Diğer	:	0,00
n-)Teminat	:	16,32
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 Vadesi	:	173,86

I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (TL)	:	0,00
I-)Katılma Payı İhraçlarından Kaynaklanan Nakit Girişleri (USD)	:	25.192,260000

İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (TL)	:	0,00
İ-)Katılma Payı İadelerinden Kaynaklanan Nakit Çıkışları (USD)	:	0,760000

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)
HİSSE SENETLERİ																			
Hisse Yabancı																			
BESI NA	EUR	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES			NL0012866412			1.050,00	68,772505	16/07/21					52,980000	1.017.882,75	0,70	0,48	0,45
MDAXEX GY	EUR	ISHARES MDAX UCITS ETF DE			DE0005933923			1.340,00	278,146545	22/10/21					228,150000	5.593.991,14	3,87	2,62	2,48
AAPL US	USD	APPLE INC			US0378331005			2.080,00	143,427178	20/10/21					162,430000	6.045.532,85	4,18	2,84	2,68
ADI US	USD	ANALOG DEVICES INC			US0326541051			1.165,00	167,968936	21/10/21					169,580000	3.535.131,41	2,45	1,66	1,57
AMAT US	USD	APPLIED MATERIALS INC			US0382221051			1.515,00	137,964568	21/10/21					104,770000	2.840.237,01	1,97	1,33	1,26
AMZN US	USD	AMAZON.COM INC			US0231351067			1.680,00	177,798661	06/06/22					137,060000	4.120.263,73	2,85	1,93	1,83
ATVI US	USD	ACTIVISION BLIZZARD INC			US00507V1098			1.500,00	67,982240	08/11/21					79,640000	2.137.605,29	1,48	1,00	0,95
AVGO US	USD	BROADCO			US11135F1012			350,00	564,122514	17/11/21					533,365000	3.340.392,99	2,31	1,57	1,48

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon Temmuz-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)	
BP US	USD	M INC BP PLC-SPONS ADR			US0556221044			7.000,00	29,543064	13/10/21					29,230000	3.661.270,88	2,53	1,72	1,62	
BWA US	USD	BORGWARNER INC DR			US0997241064			2.500,00	39,025428	20/05/22					38,320000	1.714.235,62	1,19	0,80	0,76	
DHI US	USD	HORTON INC			US23331A1097			1.135,00	93,003674	21/10/21					77,060000	1.565.055,97	1,08	0,73	0,69	
DIS US	USD	WALT DISNEY CO/THE			US2546871060			845,00	184,959716	16/07/21					104,955000	1.586.955,86	1,10	0,74	0,70	
EWG US	USD	ISHARES MSCI GERMANY ETF			US4642868065			25.000,00	31,994597	01/12/21					23,310000	10.427.670,23	7,22	4,89	4,62	
EWJ US	USD	ISHARES MSCI JAPAN ETF			US46434G8226			9.000,00	62,586866	29/06/22					55,625000	8.958.133,69	6,20	4,20	3,97	
FND US	USD	FLOOR & DECOR HOLDINGS INC-A			US3397501012			815,00	117,403313	21/10/21					79,650000	1.161.578,05	0,80	0,54	0,51	
GOOGL US	USD	ALPHABET INC-CL A			US02079K3059			2.120,00	129,544618	18/07/22					114,630000	4.348.496,84	3,01	2,04	1,93	
GS US	USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC			US38141G1040			620,00	412,787887	10/11/21					333,050000	3.694.929,30	2,56	1,73	1,64	
HEPS US	USD	D-MARKET ELECTRONIC SERV-ADR			US23292B1044			80.000,00	2,334884	01/04/22					0,867300	1.241.550,36	0,86	0,58	0,55	
IWD US	USD	ISHARES RUSSELL 1000			US4642875987			8.400,00	166,643695	29/06/22					153,692000	23.101.253,94	15,99	10,85	10,24	
JPM US	USD	VALUE ETF JPMORGAN CHASE & CO			US46625H1005			1.870,00	162,487139	10/11/21					115,910000	3.878.533,24	2,68	1,82	1,72	
LAD US	USD	LITHIA MOTORS INC			US5367971034			300,00	296,059933	20/05/22					258,160000	1.385.846,77	0,96	0,65	0,61	
LRCX US	USD	LAM RESEARCH CORP			US5128071082			242,00	638,828223	16/07/21					488,510000	2.115.406,48	1,46	0,99	0,94	
MBUU US	USD	MALIBU BOATS INC - A			US56117J1007			1.410,00	77,476468	21/10/21					61,603700	1.554.285,93	1,08	0,73	0,69	
MED US	USD	MEDIFAST INC			US58470H1014			505,00	208,105584	20/10/21					167,920000	1.517.395,56	1,05	0,71	0,67	
META US	USD	META PLATFORMS INC-CLASS A			US30303M1027			870,00	346,685586	10/11/21					157,170000	2.446.774,31	1,69	1,15	1,08	
MSFT US	USD	MICROSOFT CORP			US5949181045			1.000,00	283,561540	20/10/21					279,180000	4.995.619,00	3,46	2,34	2,21	
MTH US	USD	MERITAGE HOMES CORP			US59001A1025			1.000,00	93,986010	09/02/22					86,920000	1.555.337,79	1,08	0,73	0,69	
MU US	USD	MICRON TECHNOLOGY INC			US5951121038			1.905,00	85,591286	16/07/21					61,040000	2.080.724,16	1,44	0,98	0,92	
NFLX US	USD	NETFLIX INC			US64110L1061			400,00	523,119975	20/08/21					229,070000	1.639.582,27	1,13	0,77	0,73	
NVDA US	USD	NVIDIA CORP			US67066G1040			1.200,00	197,936142	10/06/22					178,640000	3.835.879,56	2,65	1,80	1,70	
PATH US	USD	UIPATH INC - CLASS A			US90364P1057			3.100,00	63,645245	26/08/21					18,500000	1.026.215,17	0,71	0,48	0,45	
PHM US	USD	PULTEGROUP INC			US7458671010			2.010,00	52,537920	21/10/21					43,220000	1.554.482,46	1,08	0,73	0,69	
PYPL US	USD	PAYPAL HOLDINGS INC			US70450Y1038			1.700,00	121,829794	11/02/22					87,280000	2.655.025,31	1,84	1,25	1,18	
QCOM US	USD	QUALCOMM INC			US7475251036			600,00	158,124350	01/04/22					143,780000	1.543.670,97	1,07	0,72	0,68	
RSP	USD	INVESS&P 500 EQUAL WEIGHT			US46137V3574			2.400,00	147,882508	21/10/21					145,040000	6.228.795,01	4,31	2,92	2,76	
SHEL US	USD	ROYAL DUTCH SHELL PLC.ADR			US7802593050			4.300,00	47,562360	13/10/21					52,770000	4.060.322,74	2,81	1,90	1,80	
SKX US	USD	SKECHERS USA INC-CL A			US8305661055			2.500,00	37,712800	20/05/22					37,950000	1.697.683,76	1,17	0,80	0,75	
STT US	USD	STATE STREET CORP			US8574771031			1.100,00	92,209900	01/04/22					70,860000	1.394.757,93	0,97	0,65	0,62	
URI US	USD	UNITED RENTALS INC			US9113631090			300,00	315,964867	09/02/22					316,970000	1.701.548,84	1,18	0,80	0,75	
VRTX US	USD	VERTEX PHARMACEUTICALS INC			US92532F1003			550,00	195,383618	08/07/21					276,910000	2.725.249,92	1,89	1,28	1,21	
WHR US	USD	WHIRLPOOL CORP			US9633201069			900,00	236,708000	05/01/22					173,960000	2.801.540,56	1,94	1,31	1,24	
GRUP TOPLAMI								178.277,00												
GRUP TOPLAMI								178.277,00												
BORÇLANMA SENETLERİ																				
Eurobond Türk																				
XS0861979440	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	06/12/22	127	XS0861979440	3,56	2	200.000,00	104,192800	22/10/21	9,773922				99,424767	3.558.193,68	8,92	1,67	1,58	
XS1711581337	USD	FIBABANK A	25/01/23	177	XS1711581337	4,31	2	200.000,00	103,600000	01/11/21	14,769590				96,291630	3.446.065,60	8,64	1,62	1,53	
US900123CA66	USD	HAZİNE	23/03/23	234	US900123CA66	4,68	2	1.000.000,00	98,981300	14/12/21	6,688166				99,046534	17.723.287,79	44,45	8,31	7,86	
XS1617531063	USD	GARANTİ BANKASI	24/05/27	1757	XS1617531063	5,95	2	1.000.000,00	103,521800	19/11/21	12,047336				84,652085	15.147.559,43	37,99	7,11	6,71	
GRUP TOPLAMI								2.400.000,00												
GRUP TOPLAMI								2.400.000,00												
TÜREV																				
Option																				
Call Alım																				
S&P 500 INDEX DEC2022 4500 C	USD		16/12/22		DEC2022 4500 C		0	1,00	351,000000	19/10/21					68,030000	121.732,20	-2,98	0,06	0,05	
S&P 500 INDEX DEC2022 4600 C	USD		16/12/22		DEC2022 4600 C		0	2,00	269,300000	26/01/22					45,050000	161.224,04	-3,95	0,08	0,07	
S&P 500 INDEX DEC2022 4700 C	USD		16/12/22		DEC2022 4700 C		0	5,00	327,000000	01/12/21					28,520000	255.167,01	-6,25	0,12	0,11	
S&P 500 INDEX DEC2022 4800 C	USD		16/12/22		DEC2022 4800 C		0	4,00	312,375000	27/12/21					18,260000	130.697,05	-3,20	0,06	0,06	
Put Satım																				
S&P 500 INDEX	USD		16/12/22		DEC2022 4000 P		0	-3,00	235,900000	26/01/22					159,810000	-857.887,25	21,01	-0,40	-0,38	

KRS-Kare Portföy Serbest (Döviz) Fon																				
Temmuz-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)	
DEC2022 4000 P	USD		16/12/22		DEC2022 4100 P		0	-6,00	242,500000	01/12/21					194,100000	-2.083.923,59	51,05	-0,98	-0,92	
S&P 500 INDEX																				
DEC2022 4100 P	USD		16/12/22		DEC2022 4200 P		0	-3,00	240,700000	19/11/21					241,720000	-1.297.594,05	31,78	-0,61	-0,58	
S&P 500 INDEX																				
DEC2022 4200 P	USD		16/12/22		DEC2022 4300 P		0	-1,00	243,500000	27/12/21					286,207150	-512.136,30	12,54	-0,24	-0,23	
S&P 500 INDEX																				
DEC2022 4300 P																				
GRUP TOPLAMI								-1,00								-4.082.720,89	100,00	-1,91	-1,82	
GRUP TOPLAMI								-1,00									-4.082.720,89	100,00	-1,91	-1,82
VIOP Nakit Teminatı																				
VIOP Nakit Teminatı								492.631,21								492.631,21	100,00	0,23		
GRUP TOPLAMI								492.631,21								492.631,21	100,00	0,23		
GRUP TOPLAMI								492.631,21								492.631,21	100,00	0,23		
VIOP USD Nakit Teminatı																				
VIOP USD Nakit Teminatı								1.811.772,29								32.419.672,18	100,00	0,85		
GRUP TOPLAMI								1.811.772,29								32.419.672,18	100,00	0,85		
GRUP TOPLAMI								1.811.772,29								32.419.672,18	100,00	0,85		
DİĞER																				
Döviz																				
EUR	EUR	EU			EUR			3.908,47	15,674566	29/07/22					18,297700	71.516,01	0,00	0,00	0,03	
USD	USD	FED			USD			2.527.921,53	14,070738	29/07/22					17,893900	45.234.375,07	0,00	0,00	20,05	
GRUP TOPLAMI								2.531.830,00								45.305.891,08	0,00	0,00	20,08	
GRUP TOPLAMI								2.531.830,00								45.305.891,08	0,00	0,00	20,08	
FON PORTFÖY DEĞERİ															213.191.534,65		85,64			

IV-FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
A-)FON PORTFÖY DEĞERİ	213.191.534,65	94,49 %
B-)HAZIR DEĞERLER	12.886.918,37	5,71 %
C-)ALACAKLAR	38.625,06	0,02 %
D-)DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,00 %
E-)BORÇLAR	-488.417,72	-0,22 %
F-)İHTİYAT	0,00	0,00 %
G-)VERGİ	0,00	0,00 %
FON TOPLAM DEĞERİ	225.628.660,35	100,00 %

V-AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	TUTAR	ORAN%
Portföye Alımlarda ve portföyden Satımlarda Ödenen Komisyonlar	0,00	0,0000 %
Fon Yönetim Ücreti	453.182,49	0,2009 %
Mevzuat Gereği Yapılması Zorunlu Tescil ve İlan Giderleri	623,41	0,0003 %
Kayda Alma Ücreti	3.571,38	0,0016 %
Portföydeki Varlıkların Saklanması Hizmetleri İçin Ödenen Ücretler	70.876,26	0,0314 %
Fonun Mükellefi Olduğu Vergi Ödemeleri	87,30	0,0000 %
Bağımsız Denetim Kuruluşlarına Ödenen Denetim Ücreti	550,00	0,0002 %
BİST KYD Ücreti	863,34	0,0004 %
E Defter Ücreti	290,16	0,0001 %
	530.044,34	0,2349 %

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
AVGO US	Temmettü	01/07/22	1.148,00	1.148,00
RSP	Temmettü	04/07/22	1.350,47	1.350,47
NVDA US	Temmettü	04/07/22	22,40	22,40
PHM US	Temmettü	05/07/22	241,20	241,20
LRCX US	Temmettü	06/07/22	290,40	290,40
STT US	Temmettü	13/07/22	501,60	501,60
MU US	Temmettü	26/07/22	175,26	175,26

B-Geçen Ay İçinde Yatırım Fonlarına İlişkin Mevzuatta Meydana Gelen Değişme ve Hukuki İhtilaflarla İlgili Açıklamalar

KARE PORTFÖY SERBEST (DÖVİZ) FON KALDIRAÇ VE RİSK LİMİTLERİNE UYUM RAPORU_TEMMUZ 2022

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

29.07.2022

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örnekleme Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
29.07.2022	29.07.2020	29.07.2022	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
KRS-B	12.609.250,10	1.289.587,10	10,23%	20,00%				776.975,35	6,16%

KALDIRAÇ RAPORU

29.07.2022

FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
KRS-B	12.609.250,10	35.522,54	5.984,89	0,00	7,00	0,00	- 365,29

DUYARLILIK ANALİZİ

29.07.2022

		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 (%)
KRS-B	12.609.250,10	12.609.250,10	0,00	0,00		12.609.250,10	0,00	0,00		12.609.250,10	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 (%)
KRS-B	12.609.250,10	12.609.248,72	-1,37	0,00		12.537.420,56	-71.829,54	-0,57		12.609.250,10	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 (%)
KRS-B	12.609.250,10	12.609.840,06	589,96	0,00		12.537.420,56	-71.829,54	-0,57		12.572.541,42	-36.708,68	-0,29	
		Likidite Senaryo											
	FTD	Şok Sonrası Port. (USD)	Port. Değişim (USD)	Port. Değişim (%)	Bench. Değişim (%)								
KRS-B	12.609.250,10	12.537.930,69	-71.319,41	-0,57									

FTD Fon Toplam Değeri, Amerikan Doları (USD) cinsindendir.

KRS-A Kare Portföy Serbest Fon (TRY)

Karşılaştırma Ölçütü : Yok (Eşik değer = BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD)

KRS-B Kare Portföy Serbest Fon (USD)

Karşılaştırma Ölçütü : Yok (Eşik değer = BİST-KYD 1 AYLIK GÖSTERGE MEVDUAT USD)

RMD Yöntemi

KRS-B Mutlak 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

Likidite Senaryo (KRS) Eşzamanlı olarak;

Hisse Piyasası - %8, USD faiz +100 bps, USDTRY -2% (VIOP), TL faiz +200 bps, EURUSD 2% (VIOP), Warrant -25%