

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	134,507,559.62
Fon Toplam Değeri	130,215,189.94
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	3.21

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	226,329,799.12	
Açık Pozisyon Oranı	1.74	Limit : 5,00
Kaldıraç Oranı	2.05	Limit : 5,00

RMD Özeti

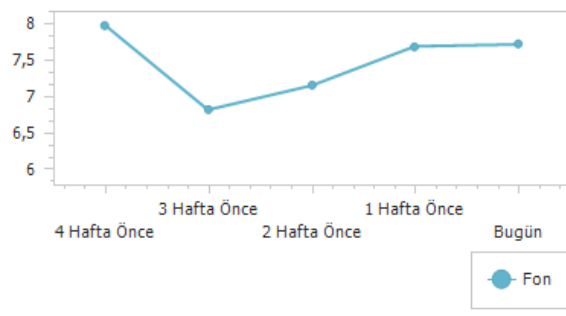
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	10,057,693.51			
RMD (%)	7.72			10.00
Beklenen Kayıp	11,553,818.50			
Beklenen Kayıp (%)	8.87			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

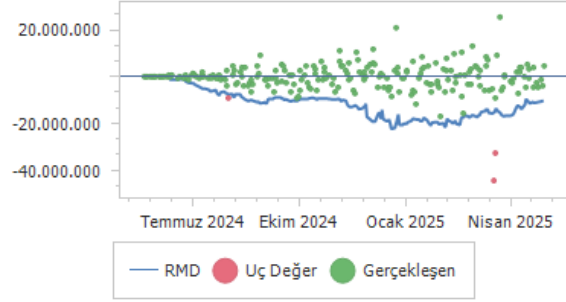
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	2,194,057	5,575	0.00
Teminat	38,562,691	133,215	0.10
Repo	-68,689,548	-114,277	-0.09
Hisse	162,440,359	4,419,408	3.39
Futures	0	4,267,721	3.28

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	19,227,452	4,216,962	3.24
Repo-AEFES 2 Day(s)	-19,052,575	-41,849	-0.03
Repo-CIMSA 2 Day(s)	-8,272,829	-19,517	-0.01
Repo-KOZAL 2 Day(s)	-16,796,349	-37,434	-0.03
Repo-MGROS 2 Day(s)	-2,506,918	-6,157	0.00
Repo-PGSUS 2 Day(s)	-22,060,877	-47,540	-0.04
F_ARCLK0525	-5,685,000	-139,306	-0.11
F_MGROS0525	47,850,000	1,571,180	1.21
F_SASA0525	-3,172,500	-94,603	-0.07
F_SISE0525	-20,520,000	-551,438	-0.42
F_TCELL0525	22,475,000	651,083	0.50
F_TKFEN0525	-10,275,000	-126,872	-0.10
F_TUPRS0525	-15,587,500	-285,401	-0.22
F_YBANK0525	72,832,000	3,071,244	2.36

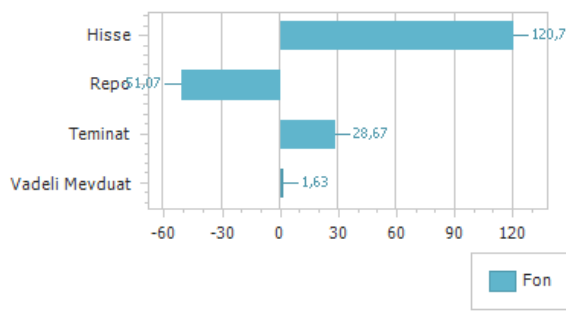
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

