

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	369,273,425.48
Fon Toplam Değeri	260,512,585.02
Risk Değeri (TRL)	5
Fon Portföyü Standart Sapması	1.98

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	120,203,000.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.46	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.57	Limit : 5,00

RMD Özeti

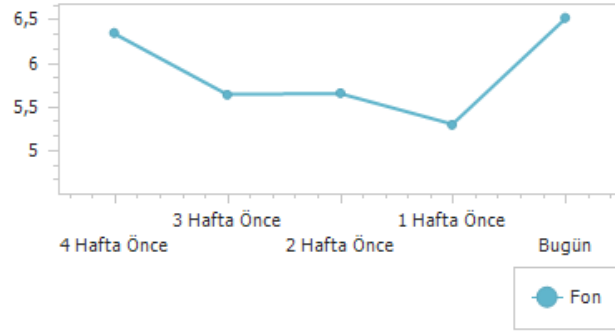
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	16,979,317.11			
RMD (%)	6.52			5.59
Beklenen Kayıp	19,505,063.26			
Beklenen Kayıp (%)	7.49			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

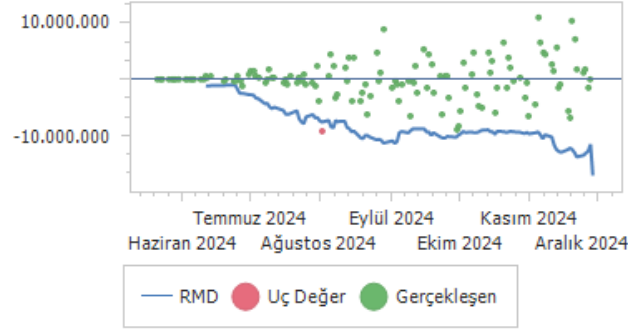
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	1,046,258	935	0.00
Teminat	23,468,405	21,945	0.01
Repo	-28,924,863	-24,473	-0.01
Ters Repo	7,028,675	6,354	0.00
Hisse	366,654,950	13,750,678	5.28
Futures	0	4,097,645	1.57

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	91,278,137	4,079,494	1.57
Repo-CCOLA 3 Day(s)	-8,803,219	-7,721	0.00
Repo-GARAN 3 Day(s)	-20,121,644	-17,288	-0.01
F_AEFES1224	29,940,000	1,037,380	0.40
F_KCHOL1224	30,075,000	976,678	0.37
F_TCELL1224	36,220,000	1,033,774	0.40
F_TKFEN1224	14,760,000	633,707	0.24
F_TTKOM1224	9,208,000	359,318	0.14

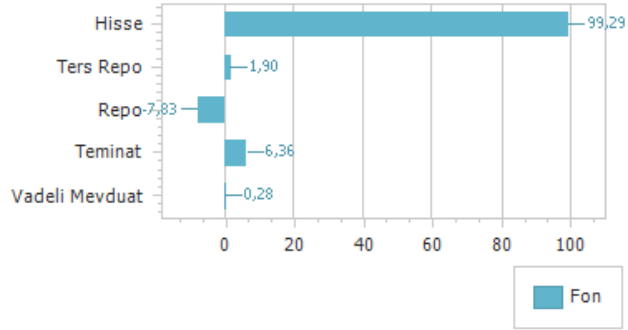
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

