

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	128,169,191.49
Fon Toplam Değeri	123,959,923.25
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	3.22

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	257,867,042.87	
Açık Pozisyon Oranı	2.08	Limit : 5,00
Kaldıraç Oranı	2.31	Limit : 5,00

RMD Özeti

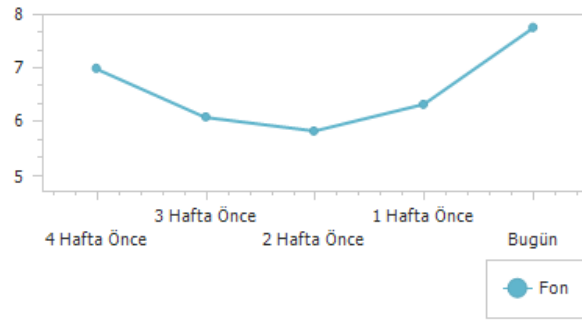
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	9,601,003.78			
RMD (%)	7.75			10.00
Beklenen Kayıp	11,029,194.22			
Beklenen Kayıp (%)	8.90			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

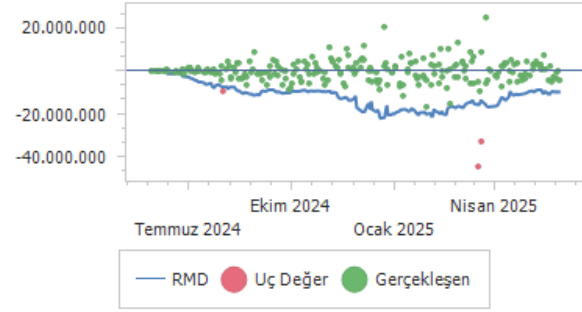
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	834,116	2,046	0.00
Takasbank Para Piyasası	-28,113,458	-56,415	-0.05
Teminat	39,209,748	135,566	0.11
Repo	-69,289,233	-110,284	-0.09
Hisse	185,528,018	4,365,906	3.52
Futures	0	3,210,356	2.59

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyükliği	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-45,272,880	3,131,799	2.53
TPP	-28,113,458	-56,415	-0.05
Repo-AEFES 3 Day(s)	-23,347,459	-48,304	-0.04
Repo-CCOLA 3 Day(s)	-11,297,158	-25,356	-0.02
Repo-MGROS 3 Day(s)	-13,054,493	-28,942	-0.02
Repo-PGSUS 3 Day(s)	-21,590,123	-45,184	-0.04
F_XU0300625	9,939,810	320,691	0.26
F_ARCLK0625	-16,864,000	-431,380	-0.35
F_MGROS0625	23,850,000	703,930	0.57
F_PETKM0625	-19,560,000	-579,228	-0.47
F_SISE0625	-13,200,000	-370,816	-0.30
F_TUPRS0625	-18,600,000	-372,909	-0.30
F_YKBANK0625	86,564,000	3,877,790	3.13

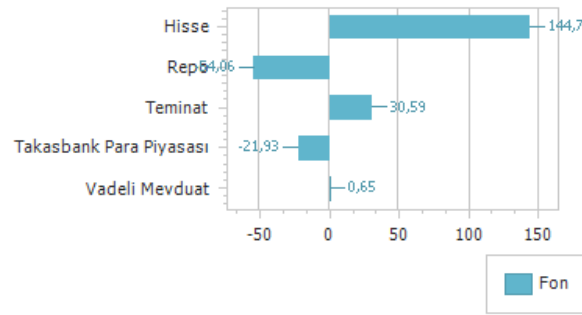
Fon RMD Trendi



Geriyeye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

