

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	170,268,771.43
Fon Toplam Değeri	164,688,114.01
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	3.54

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	454,366,131.73	
Açık Pozisyon Oranı	2.76	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	3.00	Limit : 5.00

RMD Özeti

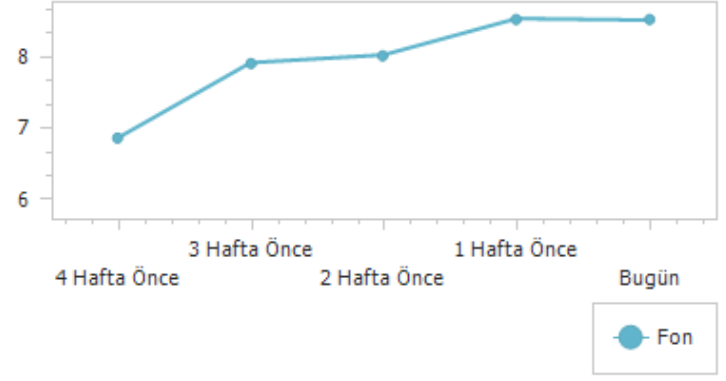
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	14,035,030.05			
RMD (%)	8.52			10.00
Beklenen Kayıp	16,122,800.89			
Beklenen Kayıp (%)	9.79			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

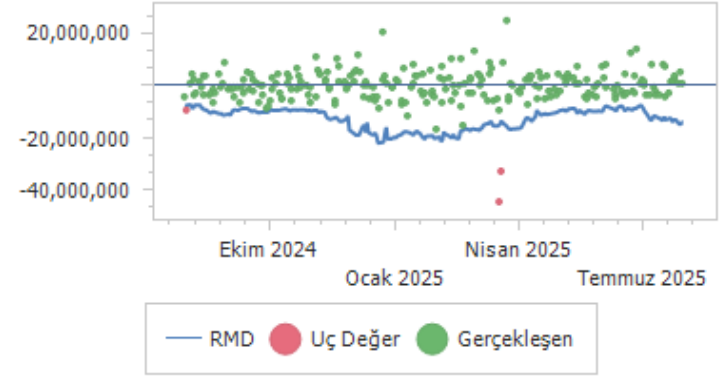
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	1,819,009	5,241	0.00
Takasbank Para Piyasası	-40,297,969	-92,734	-0.06
Teminat	68,947,644	324,508	0.20
Repo	-81,108,740	-155,595	-0.09
Hisse	220,908,827	5,502,225	3.34
Futures	0	6,064,882	3.68

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-42,128,601	5,992,454	3.64
TPP	-40,297,969	-92,734	-0.06
Repo-AEFES 1 Day(s)	-27,536,918	-67,524	-0.04
Repo-ALARK 1 Day(s)	-12,016,110	-31,996	-0.02
Repo-MGROS 1 Day(s)	-21,028,192	-53,338	-0.03
Repo-THYAO 1 Day(s)	-20,527,521	-52,206	-0.03
F_AKBNK0825	33,750,000	1,755,102	1.07
F_ARCLK0825	-24,356,970	-618,617	-0.38
F_ASELS0825	-42,075,000	-532,729	-0.32
F_BIMAS0825	18,567,500	611,459	0.37
F_EKGYO0825	34,737,500	1,644,099	1.00
F_EREGL0825	-21,376,000	-563,530	-0.34
F_GARAN0825	28,560,000	1,279,931	0.78
F_ISCTR0825	25,194,000	1,140,742	0.69
F_PETKM0825	-20,520,000	-607,923	-0.37
F_PGSUS0825	-12,600,000	-401,228	-0.24
F_SASA0825	-26,061,672	-746,299	-0.45

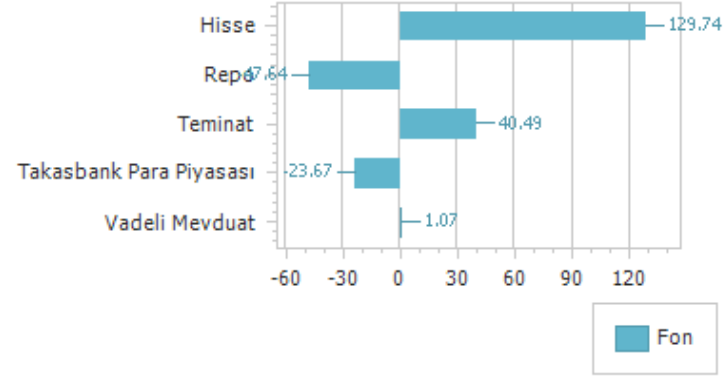
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



F_TCELL0825	34,968,750	1,079,907	0.66
F_YKBNK0825	50,490,000	2,562,044	1.56

Stress Testi

