

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	134,457,195.00
Fon Toplam Değeri	142,649,062.54
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	2.36

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	360,630,756.93	
Açık Pozisyon Oranı	2.53	Limit : 5,00
Kaldıraç Oranı	2.99	Limit : 5,00

RMD Özeti

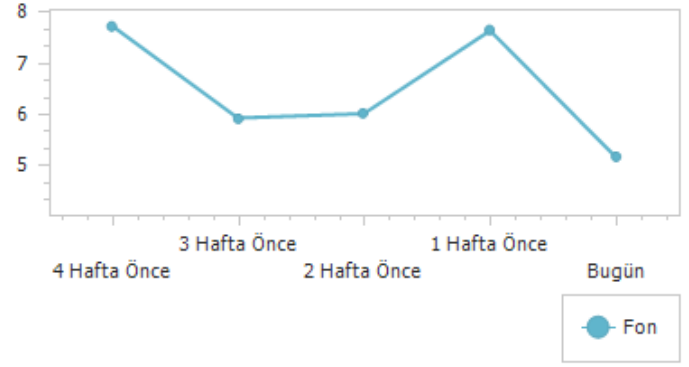
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	7,383,266.36			
RMD (%)	5.18			10.00
Beklenen Kayıp	8,481,558.85			
Beklenen Kayıp (%)	5.95			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

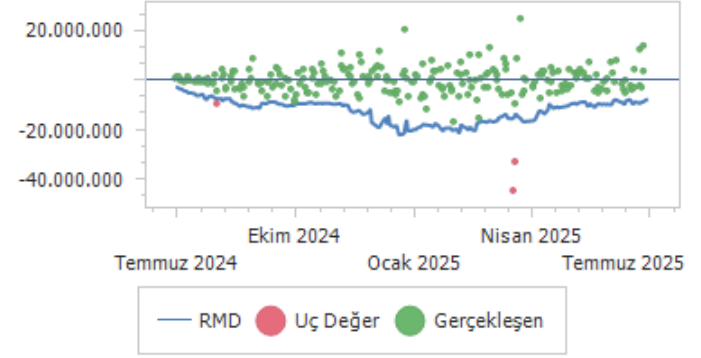
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	1,708,249	1,691	0.00
Takasbank Para Piyasası	-37,298,986	-26,856	-0.02
Teminat	57,540,696	106,339	0.07
Repo	-60,334,185	-37,005	-0.03
Hisse	172,841,421	2,276,645	1.60
Futures	0	1,181,539	0.83

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-114,038,593	1,120,805	0.79
TPP	-6,544,595	-6,021	0.00
TPP	-30,754,391	-23,254	-0.02
Repo-CCOLA 1 Day(s)	-10,765,021	-9,553	-0.01
Repo-ENJSA 1 Day(s)	-17,274,103	-14,523	-0.01
Repo-GARAN 1 Day(s)	-2,503,493	-2,386	0.00
Repo-MGROS 1 Day(s)	-12,517,466	-10,946	-0.01
Repo-PGSUS 1 Day(s)	-17,274,103	-14,523	-0.01
F_XU0300825	-27,901,350	-795,182	-0.56
F_ARCLK0725	-23,887,500	-390,896	-0.27
F_EKGYO0725	-50,400,000	-1,643,891	-1.15
F_GARAN0725	27,000,000	966,491	0.68
F_MGROS0725	24,737,500	721,507	0.51
F_PETKM0725	-15,489,000	-307,525	-0.22
F_SASA0725	-25,791,822	-567,488	-0.40
F_SISE0725	-28,832,000	-603,075	-0.42
F_TCELL0725	31,248,750	787,402	0.55
F_YKBNK0725	72,910,000	2,121,826	1.49

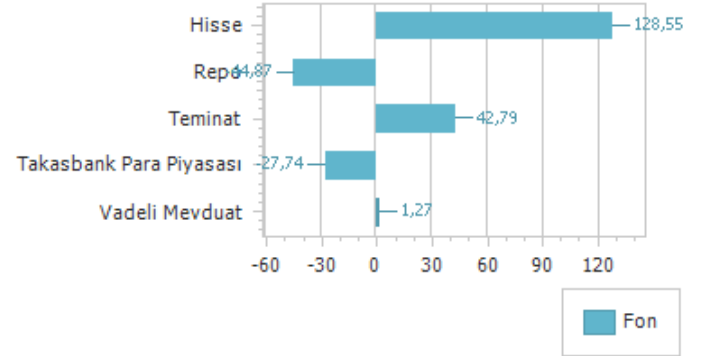
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

