

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	154,799,281.65
Fon Toplam Değeri	147,754,612.40
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	2.87

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	376,263,650.00	
Açık Pozisyon Oranı	2.55	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	2.92	Limit : 5.00

RMD Özeti

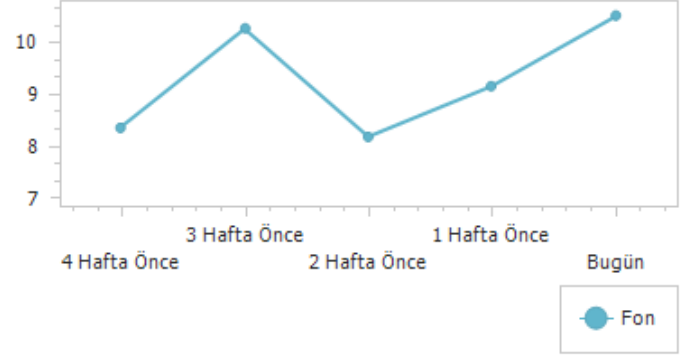
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	15,529,493.23			
RMD (%)	10.51			10.00
Beklenen Kayıp	17,839,571.86			
Beklenen Kayıp (%)	12.07			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

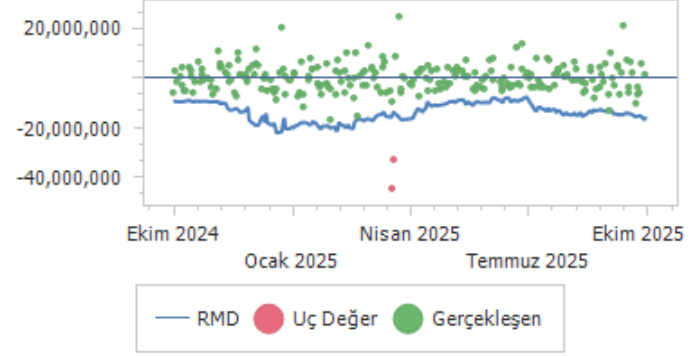
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	192,881,386	6,273,716	4.25
Vadeli Mevduat	511,576	1,053	0.00
Teminat	93,564,325	308,651	0.21
Futures	0	7,599,915	5.14
Repo	-54,819,750	-92,600	-0.06

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	106,706,900	7,574,716	5.13
F_AKBNK1025	-18,810,000	-890,631	-0.60
F_ARCLK1025	-28,462,500	-807,334	-0.55
F_BIMAS1025	5,410,000	179,686	0.12
F_EKGYO1025	31,792,000	1,481,883	1.00
F_EREGL1025	-23,520,000	-661,223	-0.45
F_ISCTR1025	59,359,250	2,597,136	1.76
F_KCHOL1025	60,515,000	2,586,316	1.75
F_PETKM1025	-25,326,000	-731,856	-0.50
F_SASA1025	-11,250,000	-360,230	-0.24
F_TCELL1025	24,462,500	762,866	0.52
F_TOASO1025	25,925,000	944,729	0.64
F_YKBNK1025	61,431,400	2,929,022	1.98
Repo-MGROS 1 Day(s)	-25,782,805	-48,057	-0.03
Repo-PGSUS 1 Day(s)	-29,036,945	-53,499	-0.04

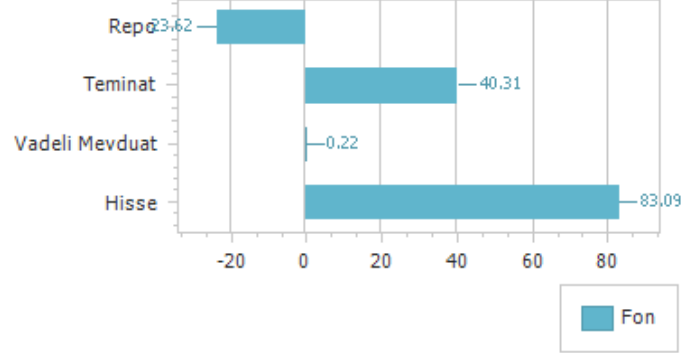
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

