

**DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon**
**Fon Bilgileri**

Fon Portföy Değeri	130,741,975.62
Fon Toplam Değeri	128,895,820.53
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	4.74

**Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi**

Açık Pozisyon Tutarı	561,535,750.00	
Açık Pozisyon Oranı	4.36	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	4.78	Limit : 5.00

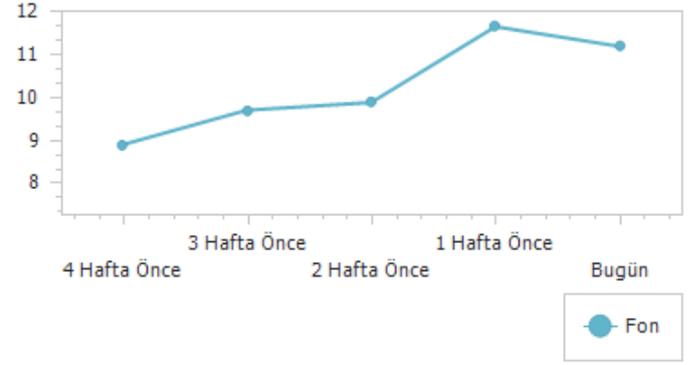
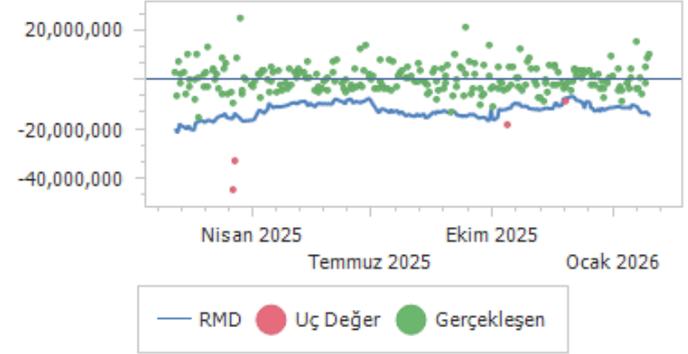
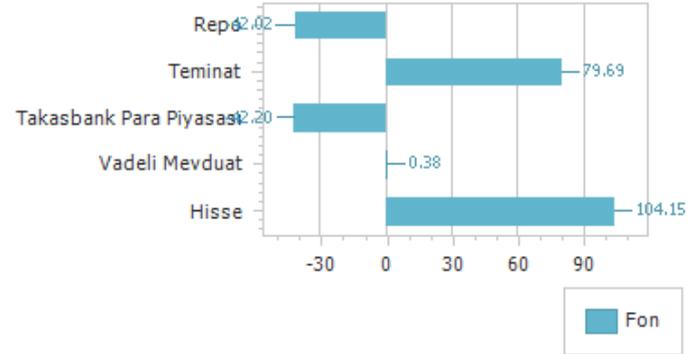
**RMD Özeti**

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	14,436,399.61			
RMD (%)	11.20			10.00
Beklenen Kayıp	16,583,875.88			
Beklenen Kayıp (%)	12.87			
Uç Değer Adedi	4			

**RMD Kırılımı**

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	136,165,886	6,689,548	5.19
Vadeli Mevduat	495,962	2,263	0.00
Takasbank Para Piyasası	-55,170,425	-180,466	-0.14
Teminat	104,191,803	1,845,702	1.43
Futures	0	8,936,386	6.93
Repo	-54,941,250	-179,926	-0.14

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-17,649,175	8,893,556	6.90
TPP	-29,089,860	-109,679	-0.09
TPP	-19,058,874	-76,353	-0.06
TPP	-7,021,690	-30,416	-0.02
F_AKBNK0226	41,827,500	1,785,424	1.39
F_ASELS0226	-60,650,000	112,422	0.09
F_ASTOR0226	-63,920,000	-1,372,413	-1.06
F_BIMAS0226	-53,120,000	-1,039,797	-0.81
F_GARAN0226	72,585,000	2,934,428	2.28
F_ISCTR0226	29,988,000	1,280,747	0.99
F_THYAO0226	45,600,000	952,899	0.74
F_TUPRS0226	-29,376,000	-257,033	-0.20
F_VAKBN0226	43,800,000	1,528,569	1.19
F_YKBNK0226	65,728,000	2,984,060	2.32
Repo-PGSUS 3 Day(s)	-40,892,346	-144,206	-0.11
Repo-SOKM 3 Day(s)	-14,048,904	-58,099	-0.05

**Fon RMD Trendi**

**Geriye Dönük Test**

**Fon Varlık Kırılımı**

**Stress Testi**

