

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi	
30.06.2025	27.06.2023	30.06.2025	Tarihsel_Benzetim1	0.99	EWMA	500	20	Risktürk	kareportfoy@kareportfoy.com.tr	
	Mutlak Risk				Görelî Risk				2013_Yaz	
KRS-B										
Tarih	FTD	RMD	RMD/FTD	RMD/FTD Limit	Kıstas RMD	Kıstas RMD/FTD	Görelî RMD	Görelî RMD Limit	Stres RMD	Stres RMD/FTD
02.06.2025	55.790.347,12	4.429.647,72	7,94%	20,00%			0,00			
03.06.2025	56.089.316,15	4.461.900,16	7,95%	20,00%			0,00			
04.06.2025	56.074.681,77	4.468.566,90	7,97%	20,00%			0,00			
05.06.2025	55.912.512,92	4.454.376,05	7,97%	20,00%			0,00			
10.06.2025	56.171.106,55	4.342.418,24	7,73%	20,00%			0,00			
11.06.2025	56.089.136,54	4.308.128,58	7,68%	20,00%			0,00			
12.06.2025	55.882.182,97	4.303.708,37	7,70%	20,00%			0,00			
13.06.2025	55.689.481,36	4.237.533,49	7,61%	20,00%			0,00			
16.06.2025	55.622.157,46	4.294.316,96	7,72%	20,00%			0,00			
17.06.2025	55.422.660,98	4.255.573,20	7,68%	20,00%			0,00			
18.06.2025	55.302.081,21	4.115.429,72	7,44%	20,00%			0,00			
19.06.2025	55.302.721,46	4.124.686,41	7,46%	20,00%			0,00			
20.06.2025	55.253.132,26	4.103.932,54	7,43%	20,00%			0,00			
23.06.2025	54.857.605,96	4.121.485,41	7,51%	20,00%			0,00			
24.06.2025	55.035.205,94	4.164.272,07	7,57%	20,00%			0,00			
25.06.2025	55.112.996,63	4.159.799,16	7,55%	20,00%			0,00			
26.06.2025	55.206.016,48	4.192.819,50	7,59%	20,00%			0,00			
27.06.2025	55.475.492,24	4.211.650,12	7,59%	20,00%			0,00			
30.06.2025	55.219.133,09	4.227.317,53	7,66%	20,00%			0,00			

KALDIRAÇ RAPORU

KRS-B									
Tarih	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD	
02.06.2025	55.790.347,12	4.658.750,71	3.817.884,26	0,08	7,00	0,07		121.647,18	
03.06.2025	56.089.316,15	4.647.759,20	3.817.723,86	0,08	7,00	0,07		121.562,90	
04.06.2025	56.074.681,77	4.637.739,23	3.929.079,97	0,08	7,00	0,07		121.471,83	
05.06.2025	55.912.512,92	4.636.241,44	3.923.579,70	0,08	7,00	0,07		121.378,36	
10.06.2025	56.171.106,55	4.629.750,76	3.942.746,68	0,08	7,00	0,07		121.054,44	
11.06.2025	56.089.136,54	4.603.391,68	3.935.436,56	0,08	7,00	0,07		120.957,84	
12.06.2025	55.882.182,97	4.580.404,07	3.892.600,81	0,08	7,00	0,07		120.888,03	
13.06.2025	55.689.481,36	4.596.569,57	3.911.819,15	0,08	7,00	0,07		120.836,48	
16.06.2025	55.622.157,46	4.585.603,11	3.918.619,93	0,08	7,00	0,07		120.629,46	
17.06.2025	55.422.660,98	4.568.756,92	3.900.122,00	0,08	7,00	0,07		120.557,58	
18.06.2025	55.302.081,21	4.555.258,49	3.875.303,20	0,08	7,00	0,07		120.478,49	
19.06.2025	55.302.721,46	4.553.673,88	3.866.829,03	0,08	7,00	0,07		120.874,21	
20.06.2025	55.253.132,26	4.553.716,40	3.873.819,62	0,08	7,00	0,07		121.407,26	
23.06.2025	54.857.605,96	4.534.845,01	3.850.331,97	0,08	7,00	0,07		122.533,83	
24.06.2025	55.035.205,94	4.549.926,42	3.880.442,24	0,08	7,00	0,07		123.053,78	
25.06.2025	55.112.996,63	4.522.228,00	3.845.365,05	0,08	7,00	0,07		123.534,77	
26.06.2025	55.206.016,48	4.523.475,46	3.848.282,79	0,08	7,00	0,07		124.021,29	
27.06.2025	55.475.492,24	4.517.052,32	3.843.131,05	0,08	7,00	0,07		124.513,74	
30.06.2025	55.219.133,09	4.515.988,61	3.851.491,60	0,08	7,00	0,07		125.921,44	

GERİYE DÖNÜK TEST RAPORU

Başlangıç Tarihi		Bitiş Tarihi		Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilite Methodu	Örneklem Sayısı	Yazılım	Mail Adresi
27.05.2025		30.06.2025		H51	0.99	EWMA	500	Risktürk	kareportfoy@kareportfoy.com.tr
Gerçekleşen Aşım Sayısı				Aşımın Gerçekleştiği Tarihler					
KAREPORTFOY									
KRS-B				0,00					