

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	163,582,605.67
Fon Toplam Değeri	157,114,102.38
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	3.47

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	516,598,150.34	
Açık Pozisyon Oranı	3.29	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	3.53	Limit : 5.00

RMD Özeti

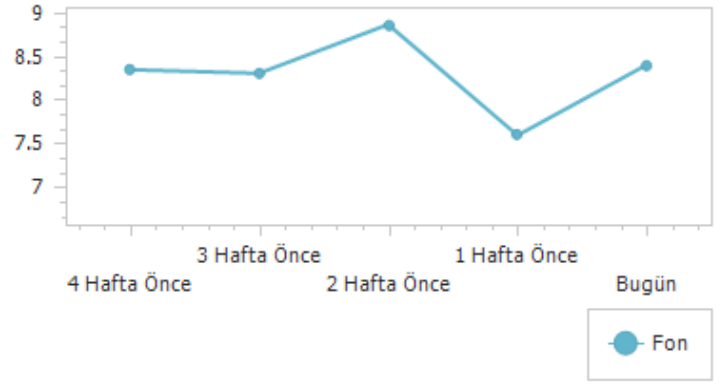
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	13,217,679.41			
RMD (%)	8.41			10.00
Beklenen Kayıp	15,183,865.84			
Beklenen Kayıp (%)	9.66			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

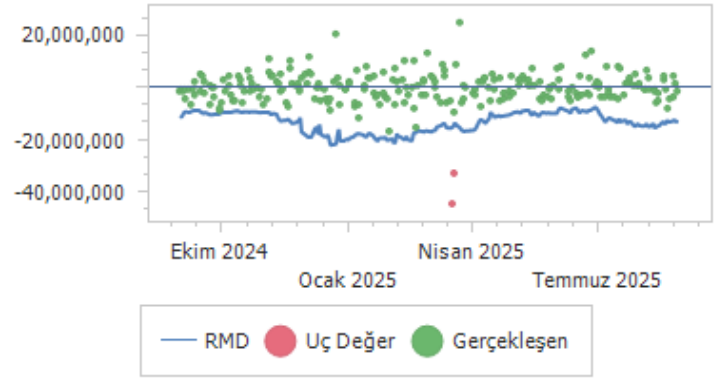
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	196,469,469	4,664,630	2.97
Vadeli Mevduat	1,123,558	2,868	0.00
Takasbank Para Piyasası	-38,637,651	-79,121	-0.05
Teminat	80,682,305	393,147	0.25
Futures	0	5,814,899	3.70
Repo	-76,055,075	-130,954	-0.08

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-50,894,651	5,752,762	3.66
TPP	-821,928	-2,073	0.00
TPP	-2,690,585	-6,710	0.00
TPP	-35,125,137	-73,218	-0.05
F_AKBK0925	54,600,000	2,495,135	1.59
F_ARCLK0925	-37,675,000	-833,549	-0.53
F_BIMAS0925	23,850,000	752,742	0.48
F_EKGYO0925	20,700,000	886,013	0.56
F_EREGL0925	-26,127,500	-559,048	-0.36
F_GUBRF0925	-34,980,000	-672,085	-0.43
F_ISCTR0925	15,132,775	630,403	0.40
F_KCHOL0925	64,155,000	2,250,159	1.43
F_PETKM0925	-38,000,000	-967,236	-0.62
F_SASA0925	-51,590,000	-1,080,789	-0.69
F_TCELL0925	14,220,000	401,198	0.26
F_YKBNK0925	59,512,800	2,825,823	1.80

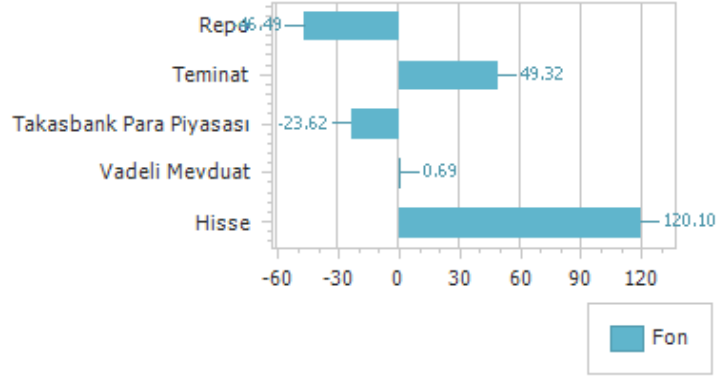
Fon RMD Trendi



Geriyeye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Repo-AEFES 3 Day(s)	-21,084,575	-47,331	-0.03
Repo-MGROS 3 Day(s)	-24,347,664	-53,698	-0.03
Repo-THYAO 3 Day(s)	-30,622,836	-65,333	-0.04

Stress Testi

