

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon
Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	132,283,935.09
Fon Toplam Değeri	130,350,830.03
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	2.10

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	194,850,000.00	
Açık Pozisyon Oranı	1.49	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	1.86	Limit : 5.00

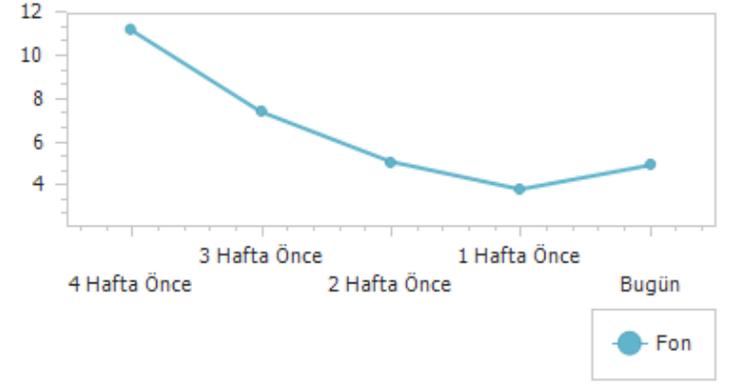
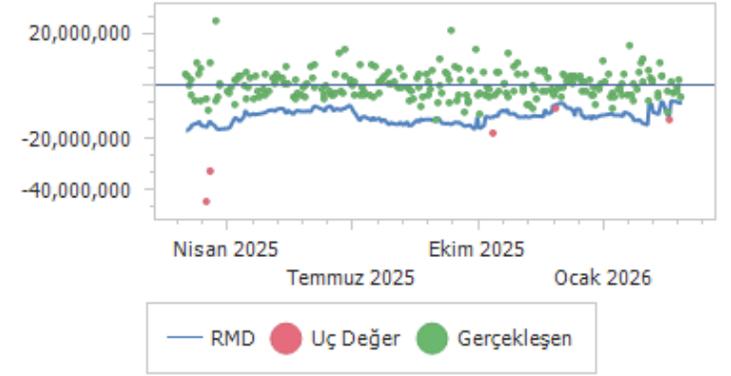
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	6,450,347.14			
RMD (%)	4.95			10.00
Beklenen Kayıp	7,409,863.91			
Beklenen Kayıp (%)	5.68			
Uç Değer Adedi	5			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyükük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	131,553,302	4,505,780	3.46
Vadeli Mevduat	796,033	561	0.00
Teminat	47,592,716	55,656	0.04
Futures	0	1,065,397	0.82
Repo	-47,658,116	-22,996	-0.02

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyükükü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-61,808,116	1,048,226	0.80
F_AEFES0326	18,950,000	307,673	0.24
F_ASELS0326	32,200,000	657,613	0.50
F_ASTOR0326	-79,900,000	-1,364,538	-1.05
F_EKGYO0326	11,850,000	170,302	0.13
F_KCHOL0326	9,980,000	182,623	0.14
F_TCELL0326	17,370,000	426,463	0.33
F_THYAO0326	-24,600,000	-400,168	-0.31
Repo-AEFES 3 Day(s)	-1,003,329	-695	0.00
Repo-SOKM 3 Day(s)	-14,046,603	-8,706	-0.01
Repo-TCELL 3 Day(s)	-32,608,185	-17,494	-0.01

Stress Testi
Fon RMD Trendi

Geriye Dönük Test

Fon Varlık Kırılımı
