

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	37,281,970.29
Fon Toplam Değeri	40,377,621.24
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	2.73

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	49,685,509.53	
Açık Pozisyon Oranı	1.23	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	1.60	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	2,371,221.47			
RMD (%)	5.87			10.00
Beklenen Kayıp	2,723,950.82			
Beklenen Kayıp (%)	6.75			
Uç Değer Adedi	3			

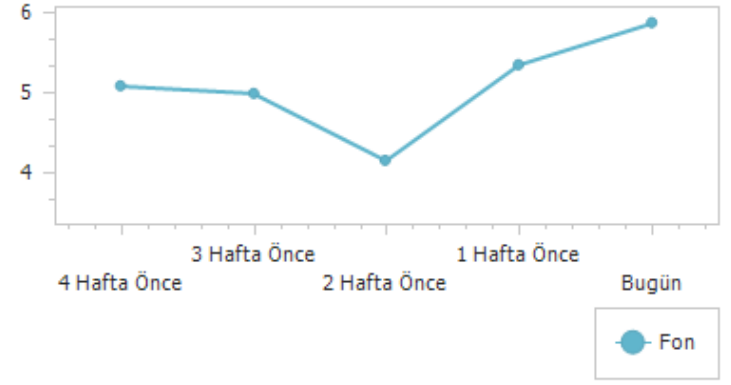
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	228,083	268	0.00
Takasbank Para Piyasası	-18,624,685	-14,211	-0.04
Teminat	14,603,592	28,456	0.07
Hisse	41,074,980	802,114	1.99
Futures	0	649,525	1.61

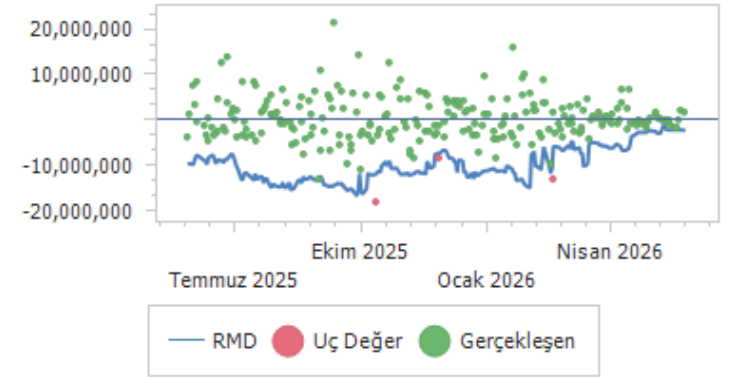
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-16,517,185	642,495	1.59
TPP	-18,624,685	-14,211	-0.04
F_AKSEN0626	24,000,000	463,653	1.15
F_ASTOR0626	-21,892,500	-164,949	-0.41

Stress Testi

Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı

