

RİSKE MARUZ DEĞER RAPORU

01.07.2026 - 31.07.2026

Portföy Tarihi	Başlangıç Tarihi	Bitiş Tarihi	Hesaplama Tipi	Güven Aralığı	Volatilité Methodu	Örneklem Sayısı	Elde Tutma Periyodu	Yazılım	Mail Adresi
31.07.2026	05.08.2024	31.07.2026	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
01.07.2026	32.494.834,12	2.738.055,11	8,43%	20,00%	5.061,94	0,02%	540,91		
02.07.2026	32.615.500,50	2.746.860,30	8,42%	20,00%	5.420,43	0,02%	506,76		
03.07.2026	32.356.548,49	2.754.613,87	8,51%	20,00%	5.209,90	0,02%	528,73		
06.07.2026	32.490.535,91	2.799.629,65	8,62%	20,00%	5.049,95	0,02%	554,39		
07.07.2026	32.303.889,08	2.748.697,39	8,51%	20,00%	5.021,87	0,02%	547,35		
08.07.2026	32.020.934,56	2.636.973,54	8,24%	20,00%	4.990,15	0,02%	528,44		
09.07.2026	32.172.032,71	2.654.585,71	8,25%	20,00%	5.345,72	0,02%	496,58		
10.07.2026	32.216.369,63	2.663.358,34	8,27%	20,00%	5.199,47	0,02%	512,24		
13.07.2026	32.063.106,27	2.598.384,25	8,10%	20,00%	5.039,25	0,02%	515,63		
14.07.2026	31.967.981,17	2.626.875,51	8,22%	20,00%	4.990,56	0,02%	526,37		
16.07.2026	31.773.776,24	2.581.443,42	8,12%	20,00%	5.291,18	0,02%	487,88		
17.07.2026	31.484.467,87	2.223.907,88	7,06%	20,00%	5.085,21	0,02%	437,33		
20.07.2026	31.403.067,29	2.216.153,88	7,06%	20,00%	4.877,88	0,02%	454,33		
21.07.2026	31.508.979,71	1.759.626,41	5,58%	20,00%	4.908,66	0,02%	358,47		
22.07.2026	31.436.556,83	1.917.107,06	6,10%	20,00%	4.922,00	0,02%	389,50		
23.07.2026	31.268.313,31	1.910.021,80	6,11%	20,00%	5.268,23	0,02%	362,55		
24.07.2026	31.203.081,92	1.895.736,59	6,08%	20,00%	5.106,98	0,02%	371,21		
27.07.2026	31.264.024,36	1.902.353,57	6,08%	20,00%	4.971,42	0,02%	382,66		
28.07.2026	31.085.790,77	1.882.105,67	6,05%	20,00%	4.932,69	0,02%	381,56		
29.07.2026	31.007.888,67	1.838.600,83	5,93%	20,00%	4.867,96	0,02%	377,69		
30.07.2026	31.067.533,13	1.996.515,72	6,43%	20,00%	5.170,07	0,02%	386,17		
31.07.2026	31.136.158,95	1.701.596,35	5,47%	20,00%	5.039,81	0,02%	337,63		

KALDIRAÇ RAPORU

KRS-B								
Tarih	FTD	Kaldıraç	Açık Pozisyon	Kaldıraç / FTD	Kaldıraç / FTD Limit	Açık Pozisyon / FTD	Açık Pozisyon / FTD Limit	Kaldıraçlı İşlem RMD
01.07.2026	32.494.834,12			0,00	7,00	0,00		
02.07.2026	32.615.500,50			0,00	7,00	0,00		
03.07.2026	32.356.548,49			0,00	7,00	0,00		
06.07.2026	32.490.535,91			0,00	7,00	0,00		
07.07.2026	32.303.889,08			0,00	7,00	0,00		
08.07.2026	32.020.934,56			0,00	7,00	0,00		
09.07.2026	32.172.032,71			0,00	7,00	0,00		
10.07.2026	32.216.369,63			0,00	7,00	0,00		
13.07.2026	32.063.106,27			0,00	7,00	0,00		
14.07.2026	31.967.981,17			0,00	7,00	0,00		
16.07.2026	31.773.776,24			0,00	7,00	0,00		
17.07.2026	31.484.467,87			0,00	7,00	0,00		
20.07.2026	31.403.067,29			0,00	7,00	0,00		
21.07.2026	31.508.979,71			0,00	7,00	0,00		
22.07.2026	31.436.556,83	4.132.745,18	4.132.745,18	0,13	7,00	0,13		82.976,76
23.07.2026	31.268.313,31	4.131.360,20	4.131.360,20	0,13	7,00	0,13		82.414,25
24.07.2026	31.203.081,92	4.135.635,34	4.135.635,34	0,13	7,00	0,13		82.314,26
27.07.2026	31.264.024,36	4.124.642,20	4.124.642,20	0,13	7,00	0,13		81.642,74
28.07.2026	31.085.790,77	4.115.889,44	4.115.889,44	0,13	7,00	0,13		80.982,94
29.07.2026	31.007.888,67	4.112.075,25	4.112.075,25	0,13	7,00	0,13		80.685,59
30.07.2026	31.067.533,13	4.111.783,03	4.111.783,03	0,13	7,00	0,13		80.552,23
31.07.2026	31.136.158,95	4.107.787,06	4.107.787,06	0,13	7,00	0,13		75.849,67