

DKR - Deniz Portföy Öndördüncü Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	145,863,145.67
Fon Toplam Değeri	126,645,690.13
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	3.54

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	438,172,508.24	
Açık Pozisyon Oranı	3.46	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	3.93	Limit : 5.00

RMD Özeti

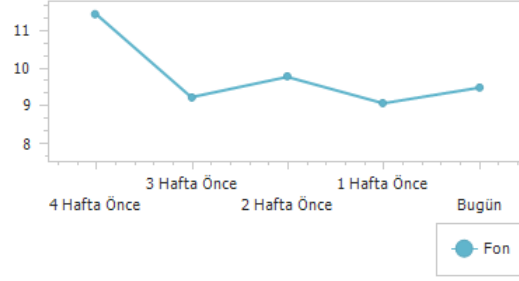
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	12,020,580.39			
RMD (%)	9.49			10.00
Beklenen Kayıp	13,808,693.21			
Beklenen Kayıp (%)	10.90			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

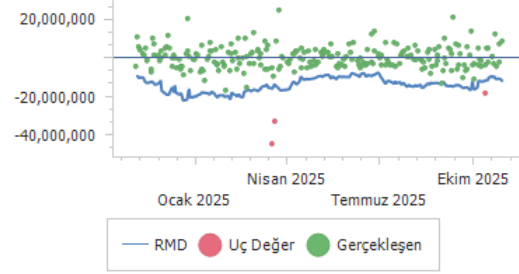
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	254,541,254	5,850,740	4.62
Vadeli Mevduat	823,320	2,464	0.00
Takasbank Para Piyasası	-93,811,240	-178,114	-0.14
Teminat	58,332,585	274,901	0.22
Futures	0	2,363,927	1.87
Repo	-74,022,774	-151,863	-0.12

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-174,523,614	2,199,979	1.74
TPP	-19,139,500	-50,947	-0.04
TPP	-25,083,219	-64,654	-0.05
TPP	-25,522,677	-65,633	-0.05
TPP	-24,065,844	-62,369	-0.05
F_EKGYO1125	24,264,000	994,515	0.79
F_ENJSA1125	-16,500,000	-422,195	-0.33
F_FROTO1125	-29,775,000	-579,853	-0.46
F_GARAN1125	47,110,000	1,920,029	1.52
F_ISCTR1125	5,060,000	204,075	0.16
F_MGROS1125	27,210,000	737,456	0.58
F_SASA1125	-13,815,000	-342,242	-0.27
F_SISE1125	-33,102,000	-787,395	-0.62
F_TTKOM1125	-25,500,000	-794,733	-0.63
F_TUPRS1125	-49,400,000	-644,194	-0.51
F_YBANK1125	57,758,400	2,390,106	1.89
Repo-ASTOR 3 Day(s)	-12,797,158	-35,301	-0.03
Repo-MGROS 3 Day(s)	-24,088,767	-62,421	-0.05
Repo-PGSUS 3 Day(s)	-37,136,849	-89,974	-0.07

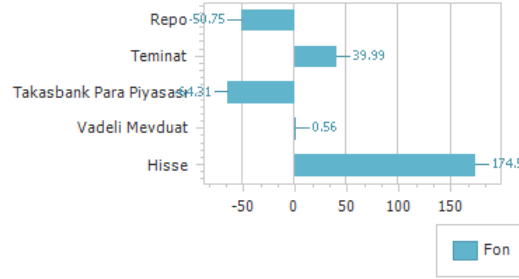
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

