

DKR - Deniz Portföy Ondördüncü Serbest Fon
Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	99,419,652.91
Fon Toplam Değeri	101,200,683.89
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	3.19

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	344,937,028.16	
Açık Pozisyon Oranı	3.41	Limit : 5.00
Kaldıraç Oranı	4.03	Limit : 5.00

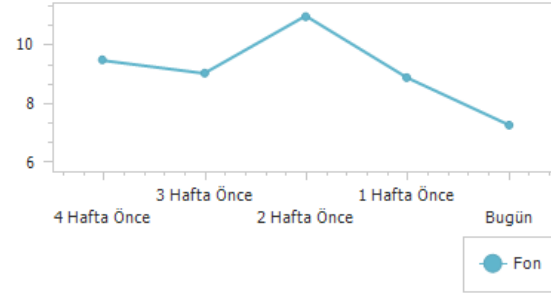
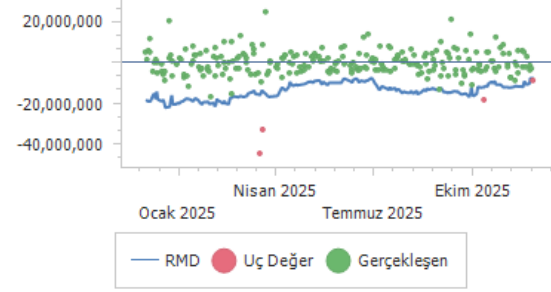
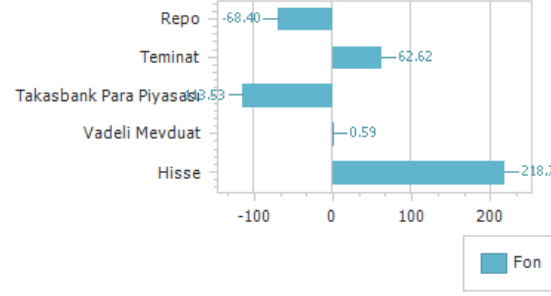
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	7,385,648.21			
RMD (%)	7.30			10.00
Beklenen Kayıp	8,484,295.01			
Beklenen Kayıp (%)	8.38			
Uç Değer Adedi	4			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	217,448,181	2,947,466	2.91
Vadeli Mevduat	582,948	1,229	0.00
Takasbank Para Piyasası	-112,869,863	-122,063	-0.12
Teminat	62,258,969	317,363	0.31
Futures	0	-713,247	-0.70
Repo	-68,000,582	-89,663	-0.09

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyükliği	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-239,299,945	-898,484	-0.89
TPP	-54,925,987	-77,708	-0.08
TPP	-30,098,630	-49,718	-0.05
TPP	-27,845,246	-46,723	-0.05
F_AEFES1225	789,500	15,524	0.02
F_ASELS1225	9,170,000	157,304	0.16
F_ASTOR1225	22,650,000	537,569	0.53
F_GUBRF1225	31,275,000	801,961	0.79
F_HALKB1225	-44,525,000	-839,998	-0.83
F_ISCTR1225	20,355,000	311,315	0.31
F_SASA1225	-8,760,000	-190,066	-0.19
F_SISE1225	-44,784,000	-879,711	-0.87
F_TTKOM1225	-44,600,000	-966,049	-0.95
Repo-ASTOR 3 Day(s)	-8,280,514	-16,148	-0.02
Repo-CCOLA 3 Day(s)	-18,568,425	-33,347	-0.03
Repo-PGSUS 3 Day(s)	-41,151,644	-63,204	-0.06

Fon RMD Trendi

Geriye Dönük Test

Fon Varlık Kırılımı

Stress Testi
