

DDA - Deniz Portföy Bankacılık Sektörü Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun)

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	461,961,508.25
Fon Toplam Değeri	459,746,981.65
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	2.77

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	157,036,500.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.34	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.48	Limit : 5.00

RMD Özeti

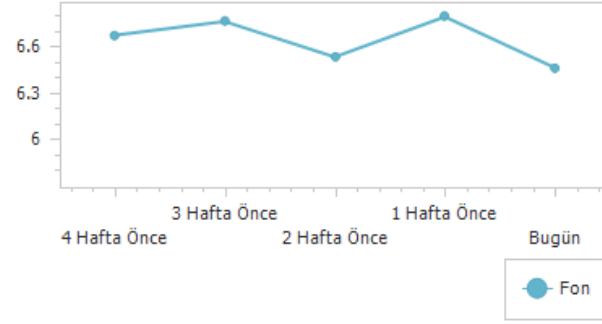
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	29,736,828.53			
RMD (%)	6.47			10.00
Beklenen Kayıp	34,160,309.15			
Beklenen Kayıp (%)	7.43			
Uç Değer Adedi	4			

RMD Kırılımı

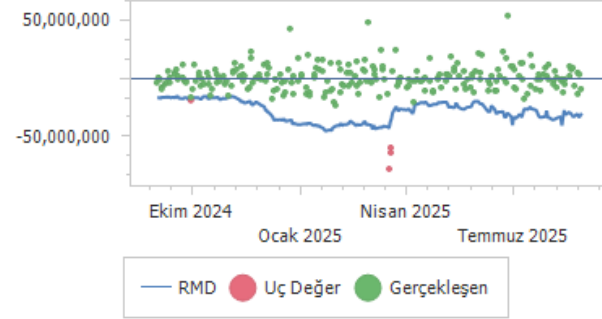
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	425,452,500	23,392,033	5.09
Fon	6,033,525	119,818	0.03
Vadeli Mevduat	1,233,978	2,136	0.00
Teminat	26,230,976	47,978	0.01
Futures	0	6,310,640	1.37
Ters Repo	3,010,529	5,230	0.00

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	94,920,500	6,310,640	1.37
F_XU0301025	-62,116,000	-2,000,668	-0.44
F_AKBK0925	68,250,000	3,886,389	0.85
F_GARAN0925	64,845,000	3,379,522	0.74
F_TSKB0925	23,941,500	960,223	0.21

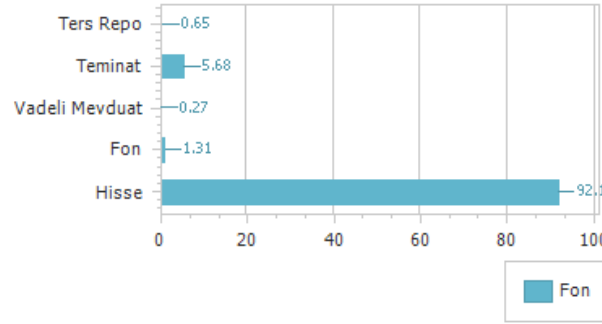
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

