

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

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	439,152,938.22
Fon Toplam Değeri	422,724,092.41
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	2.53

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	101,600,000.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.24	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.24	Limit : 5.00

RMD Özeti

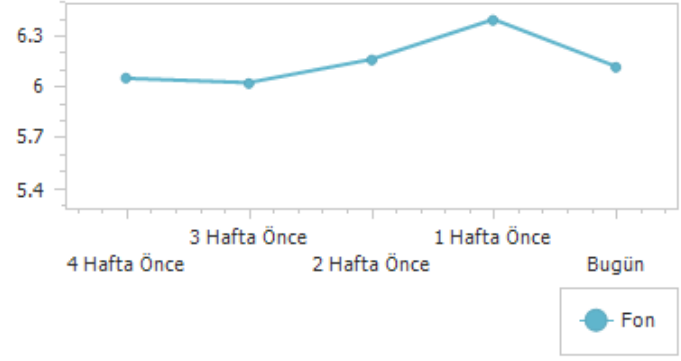
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	25,888,859.72			
RMD (%)	6.12			10.00
Beklenen Kayıp	29,739,938.50			
Beklenen Kayıp (%)	7.04			
Uç Değer Adedi	5			

RMD Kırılımı

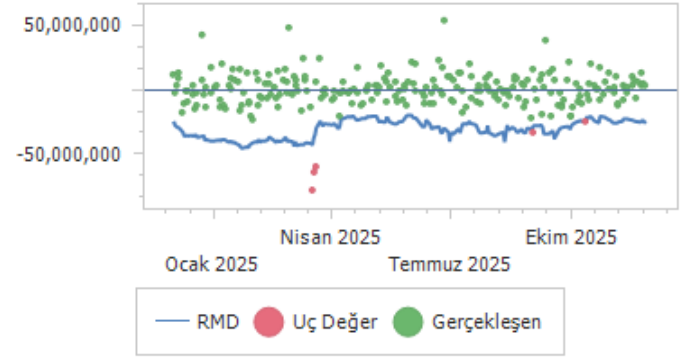
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	387,685,000	20,450,565	4.84
Vadeli Mevduat	733,540	949	0.00
Teminat	21,640,533	29,484	0.01
Futures	0	5,296,085	1.25
Ters Repo	29,093,865	40,392	0.01

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	101,600,000	5,296,085	1.25
F_GARAN1225	69,450,000	3,792,448	0.90
F_TSKB1225	32,150,000	1,487,445	0.35

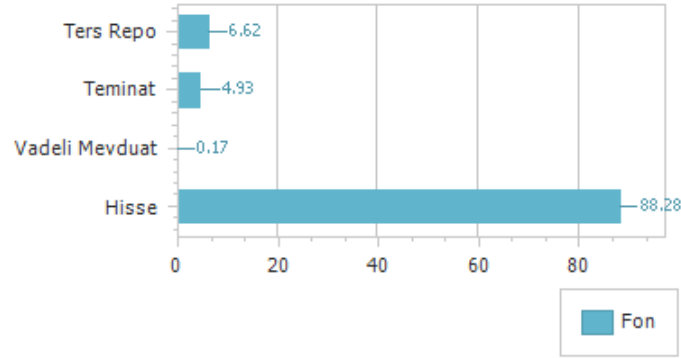
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

