

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

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	415,303,484.12
Fon Toplam Değeri	405,729,329.47
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	2.77

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	115,715,000.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.29	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.29	Limit : 5.00

RMD Özeti

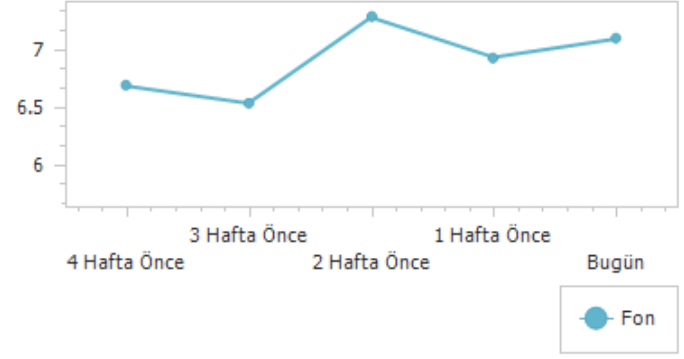
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	28,786,985.85			
RMD (%)	7.10			10.00
Beklenen Kayıp	33,069,173.30			
Beklenen Kayıp (%)	8.15			
Uç Değer Adedi	4			

RMD Kırılımı

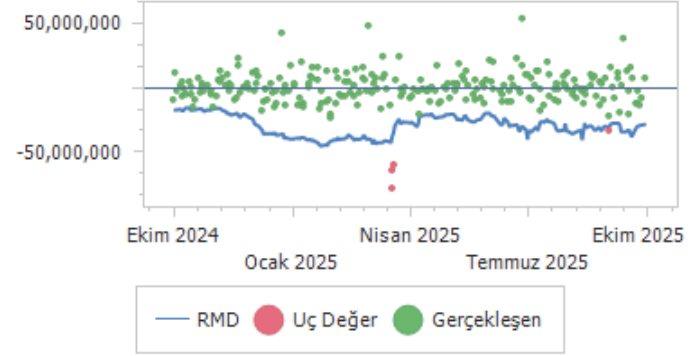
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	424,595,000	22,706,876	5.60
Vadeli Mevduat	582,100	1,004	0.00
Teminat	21,161,800	38,210	0.01
Futures	0	6,379,080	1.57

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	115,715,000	6,379,080	1.57
F_AKBNK1025	31,350,000	1,752,362	0.43
F_GARAN1025	41,940,000	2,304,957	0.57
F_YKBNK1025	42,425,000	2,285,792	0.56

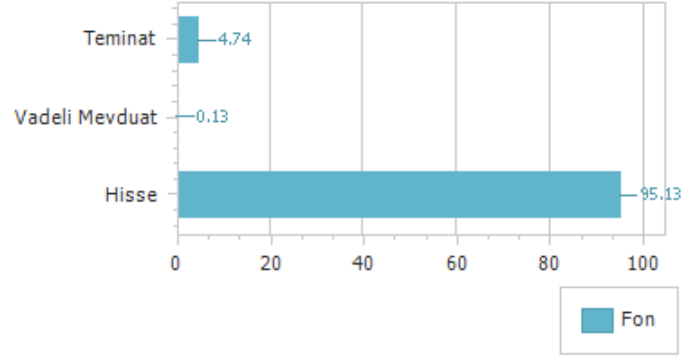
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

