

DPI - Deniz Portföy İstatistiksel Arbitraj Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)
Fon Bilgileri

| | |
|-------------------------------|----------------|
| Fon Portföy Değeri | 301,260,385.96 |
| Fon Toplam Değeri | 272,383,538.66 |
| Risk Değeri (TRL) | 2 |
| Fon Portföyü Standart Sapması | 0.07 |

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

| | | |
|----------------------|------|---------------|
| Açık Pozisyon Tutarı | 0.00 | |
| Açık Pozisyon Oranı | 0.00 | Limit : 10.00 |
| Kaldıraç Oranı | 0.85 | Limit : 10.00 |

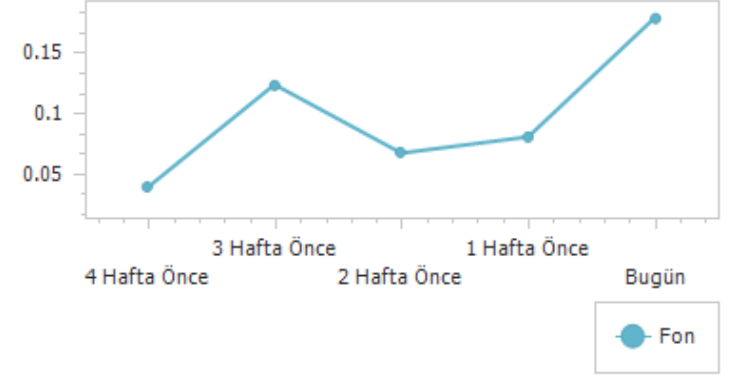
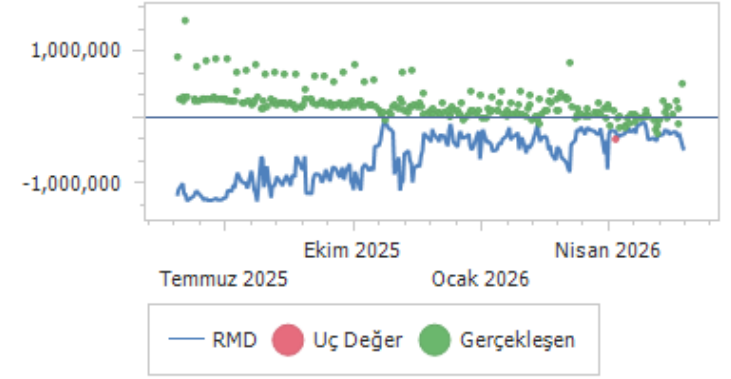
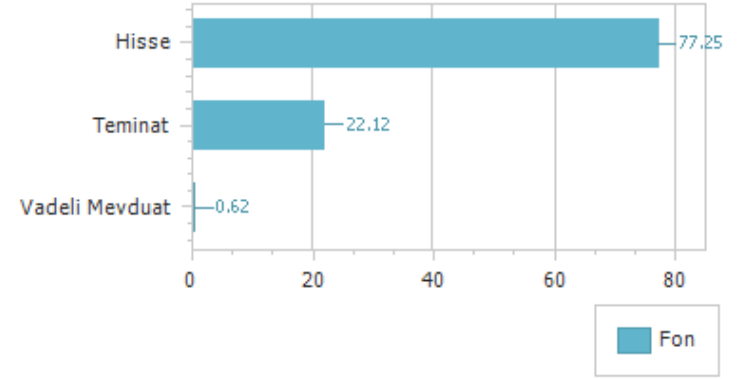
RMD Özeti

| | Fon | Kıstas | Görelî | Limit |
|--------------------|------------|--------|--------|-------|
| RMD | 490,108.50 | | | |
| RMD (%) | 0.18 | | | |
| Beklenen Kayıp | 563,014.23 | | | |
| Beklenen Kayıp (%) | 0.21 | | | |
| Uç Değer Adedi | 1 | | | |

RMD Kırılımı

| Piyasa | Büyükük | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|----------------|-------------|-------------|---------------|
| Vadeli Mevduat | 1,872,675 | 6,800 | 0.00 |
| Teminat | 66,650,905 | 162,518 | 0.06 |
| Hisse | 232,736,806 | -11,683,433 | -4.29 |
| Futures | 0 | -12,048,399 | -4.42 |

| Kaldıraç Yaratan İşlemler | Sözleşme Büyüküküğü | Artık RMD | Artık RMD (%) |
|---------------------------|---------------------|-------------|---------------|
| Toplam | -231,736,508 | -12,048,399 | -4.42 |
| F_AEFES0626 | -14,492,370 | -341,087 | -0.13 |
| F_AKBNK0626 | -29,971,200 | -1,417,343 | -0.52 |
| F_BRSAN0626 | -3,569,700 | 41,489 | 0.02 |
| F_GARAN0626 | -18,742,250 | -460,487 | -0.17 |
| F_HEKTS0626 | -9,196,000 | -426,361 | -0.16 |
| F_ISCTR0626 | -35,008,902 | -1,329,642 | -0.49 |
| F_ODAS0626 | -1,728,312 | 21,086 | 0.01 |
| F_OYAKC0626 | -1,603,140 | 43,888 | 0.02 |
| F_SAHOL0626 | -11,196,400 | -88,935 | -0.03 |
| F_SASA0626 | -40,051,440 | -3,281,014 | -1.20 |
| F_THYAO0626 | -30,327,850 | -976,152 | -0.36 |
| F_TRALT0626 | -1,637,104 | 45,196 | 0.02 |
| F_TUPRS0626 | -12,400,500 | -356,852 | -0.13 |
| F_VAKBN0626 | -4,733,940 | 58,152 | 0.02 |
| F_YKBNK0626 | -17,077,400 | -489,695 | -0.18 |

Fon RMD Trendi

Geriye Dönük Test

Fon Varlık Kırılımı


Stress Testi

