FON RİSK RAPORU

30-06-2026

MTG - Deniz Portföy Mutlak Getiri Hedefli Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	106,869,725.15	
Fon Toplam Değeri	124,271,594.09	
Risk Değeri (TRL)	2	
Fon Portföyü Standart Sapması	0.28	

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	71,592,500.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.58	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.58	Limit : 5.00

RMD Özeti

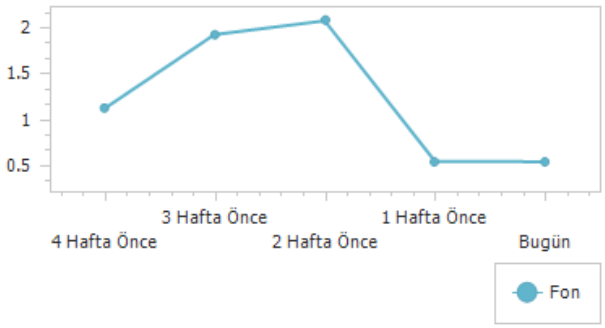
	Fon	Kıstas	Göreli	Limit
RMD	684,944.50			
RMD (%)	0.55			5.59
Beklenen Kayıp	786,832.93			
Beklenen Kayıp (%)	0.63			
Uç Değer Adedi	4			

RMD Kırılımı

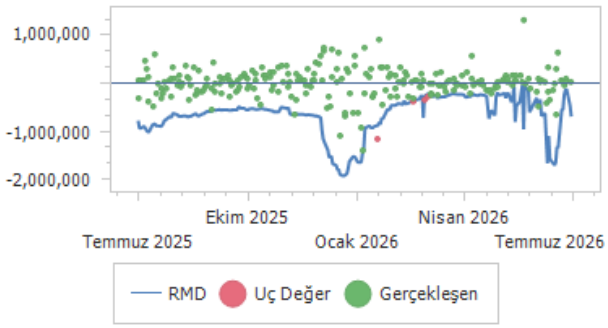
Piyasa	Büyüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	506,489	105	0.00
Takasbank Para Piyasası	7,008,016	1,294	0.00
Teminat	18,742,718	2,693	0.00
Hisse	80,612,501	-2,295,637	-1.85
Futures	0	-2,625,491	-2.11

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-71,592,500	-2,625,491	-2.11
F_AKBNK0726	-14,437,500	-523,508	-0.42
F_GARAN0726	-8,970,000	-225,315	-0.18
F_KCHOL0726	-5,805,000	-99,083	-0.08
F_THYAO0726	-42,380,000	-1,444,818	-1.16

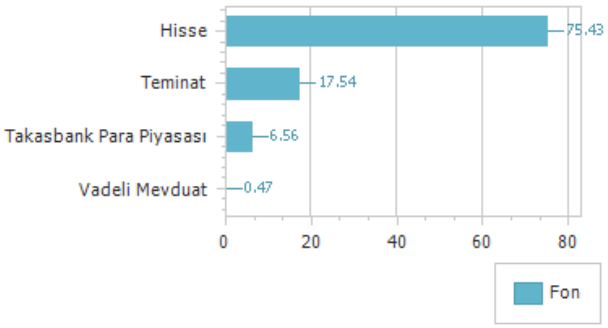
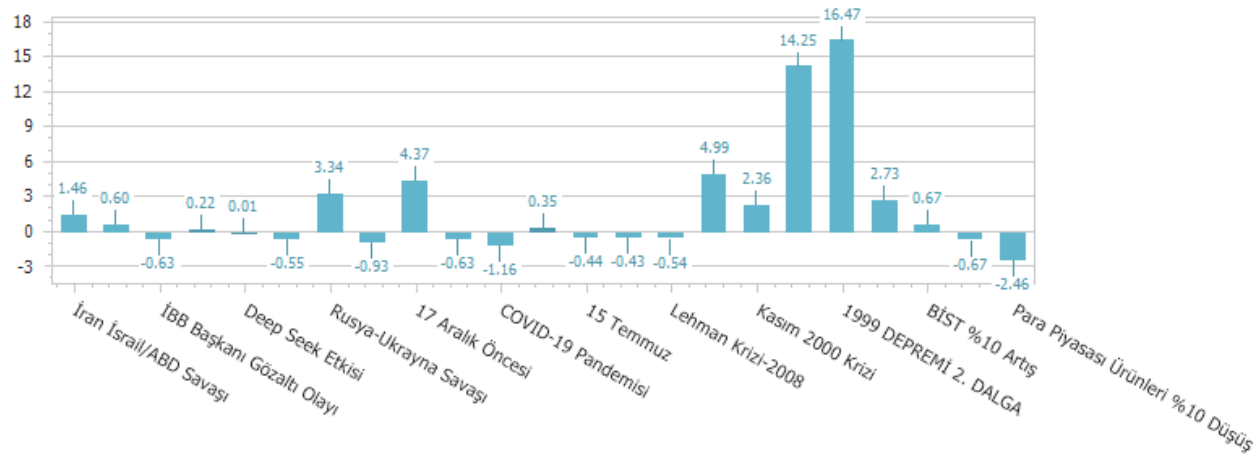
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi