

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

Fon Portföy Değeri	308,587,722.73
Fon Toplam Değeri	355,496,153.31
Risk Değeri (TRL)	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.06

**Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi**

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.00	Limit : 10.00
Kaldıraç Oranı	1.05	Limit : 10.00

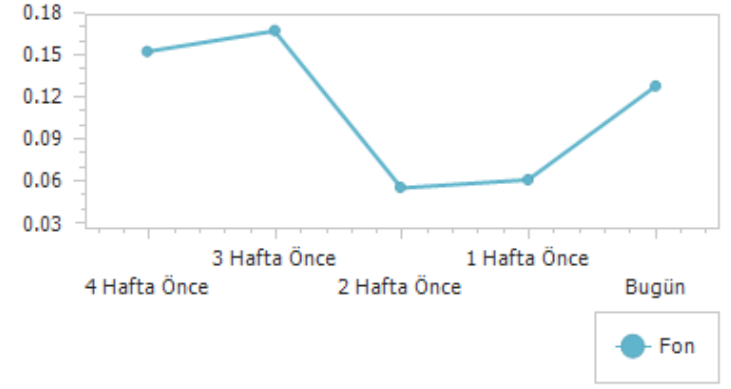
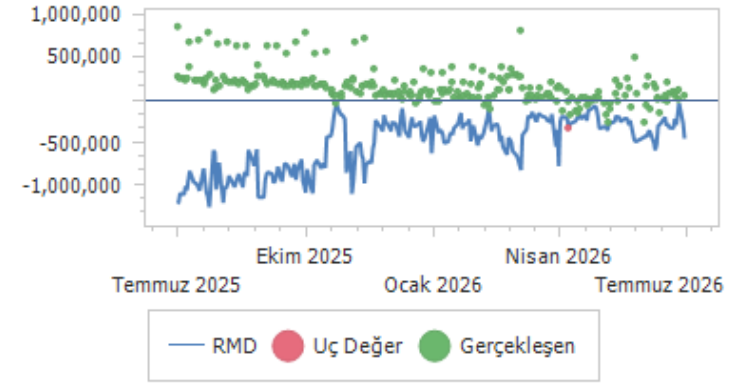
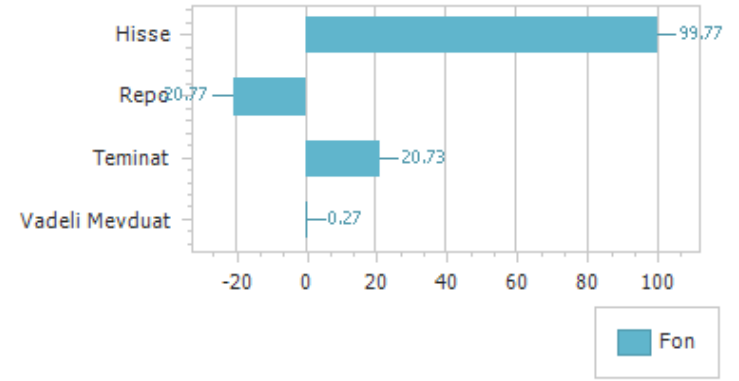
**RMD Özeti**

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	453,945.03			
RMD (%)	0.13			
Beklenen Kayıp	521,471.30			
Beklenen Kayıp (%)	0.15			
Uç Değer Adedi	1			

**RMD Kırılımı**

Piyasa	Büyükük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	823,671	-44	0.00
Teminat	63,957,999	-86,063	-0.02
Repo	-64,078,904	-82,658	-0.02
Hisse	307,884,957	-2,878,965	-0.81
Futures	0	-14,872,886	-4.18

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyükükü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-371,963,566	-14,928,406	-4.20
Repo-THYAO 1 Day(s)	-59,072,740	-70,940	-0.02
Repo-THYAO 1 Day(s)	-5,006,164	-390	0.00
F_AEFES0726	-3,940,792	123,458	0.03
F_AKBNK0726	-18,557,000	-563,098	-0.16
F_ASTOR0726	-14,820,400	-997,377	-0.28
F_EKGYO0726	-12,871,232	-25,461	-0.01
F_ENKAI0726	-7,321,450	89,133	0.03
F_EREGL0726	-20,972,688	-614,551	-0.17
F_FROTO0726	-6,814,730	175,286	0.05
F_GARAN0726	-30,898,200	-1,002,016	-0.28
F_HEKTS0726	-17,768,190	-1,165,561	-0.33
F_ISCTR0726	-14,857,392	-80,035	-0.02
F_KCHOL0726	-3,018,600	111,459	0.03
F_ODAS0726	-2,175,796	78,490	0.02

**Fon RMD Trendi**

**Geriyeye Dönük Test**

**Fon Varlık Kırılımı**


F_PETKM0726	-8,117,928	-158,334	-0.04
F_PGSUS0726	-7,967,050	195,885	0.06
F_SASA0726	-47,814,935	-3,329,087	-0.94
F_SISE0726	-18,012,380	-377,864	-0.11
F_TAVHL0726	-15,439,075	-298,798	-0.08
F_TCELL0726	-2,706,480	96,913	0.03
F_THYAO0726	-22,885,200	-406,885	-0.11
F_TRALT0726	-16,568,748	-748,499	-0.21
F_TUPRS0726	-1,797,250	-12,630	0.00
F_ULKER0726	-1,926,420	61,055	0.02
F_VAKBN0726	-5,683,464	134,650	0.04
F_YKBNK0726	-4,949,262	197,237	0.06

## Stress Testi

