FON RİSK RAPORU

30.11.2023

DFD - Deniz Portföy Emtia Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	12,588,844.70	
Fon Toplam Değeri	10,755,712.21	
Risk Değeri (TRL)	6	
Fon Portföyü Standart Sapması	0.69	

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	
Açık Pozisyon Oranı	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	Limit : 1,00

RMD Özeti

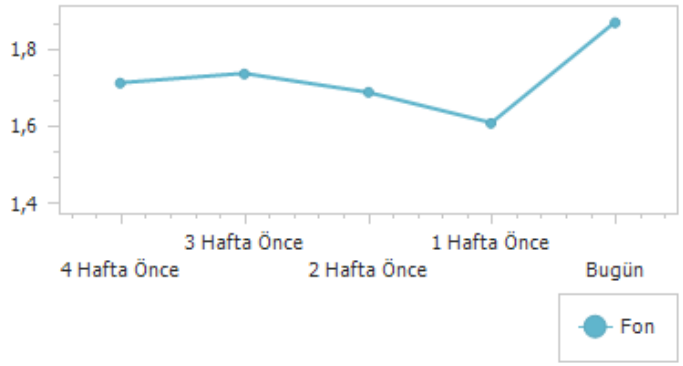
	Fon	Kıstas	Göreli	Limit
RMD	201,554.52			
RMD (%)	1.87			5.59
Beklenen Kayıp	231,536.61			
Beklenen Kayıp (%)	2.15			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

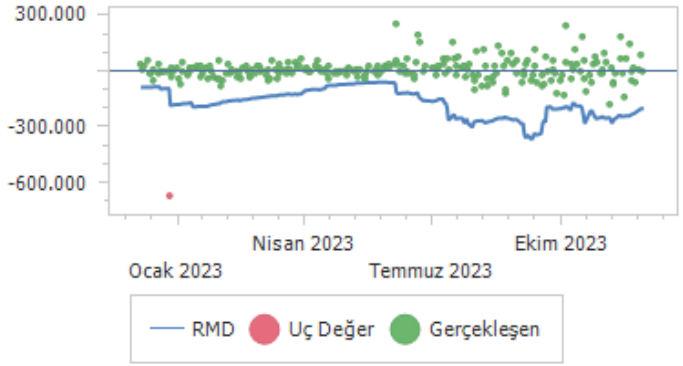
Piyasa	Büyüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	163,152	103	0.00
Takasbank Para Piyasası	570,670	357	0.00
Hisse	7,477,085	128,191	1.19
Borsa Yatırım Fonları	788,250	9,510	0.09
Fon	3,386,088	55,138	0.51
Kıymetli Maden	203,600	3,486	0.03

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)

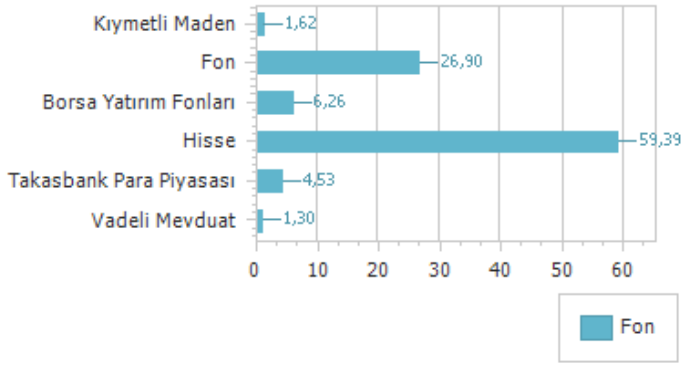
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

