

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

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	155,497,529.18
Fon Toplam Değeri	149,363,872.10
Risk Değeri (TRL)	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.47

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	101,504,000.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.68	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.68	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	1,701,158.32			
RMD (%)	1.14			5.59
Beklenen Kayıp	1,954,212.90			
Beklenen Kayıp (%)	1.31			
Uç Değer Adedi	5			

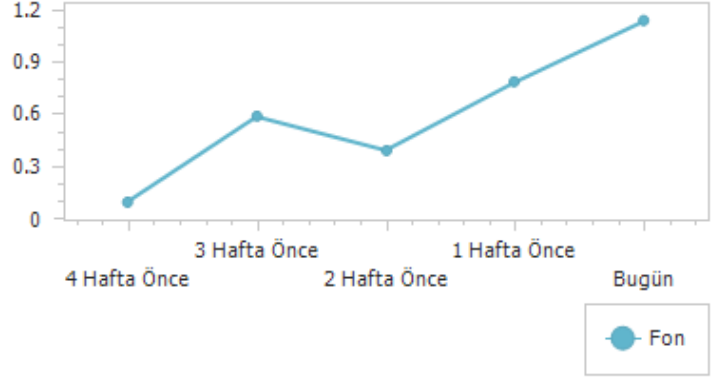
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	782,395	166	0.00
Takasbank Para Piyasası	3,511,090	734	0.00
Teminat	28,520,044	5,185	0.00
Hisse	122,684,001	-2,924,336	-1.96
Futures	0	-3,867,459	-2.59

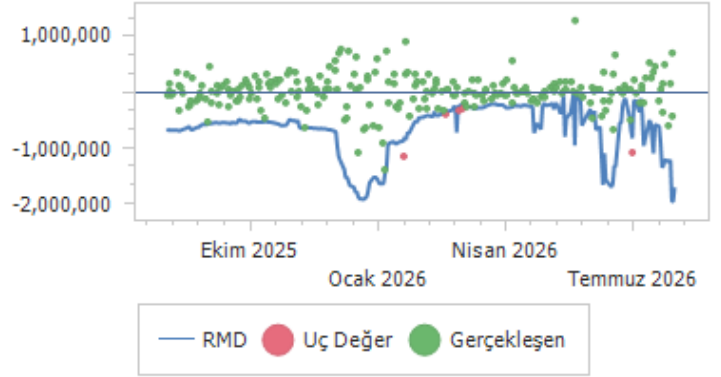
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-99,036,000	-3,867,459	-2.59
F_AKBNK0826	-47,233,000	-2,034,959	-1.36
F_GARAN0826	1,234,000	15,690	0.01
F_THYAO0826	-42,390,000	-1,226,963	-0.82
F_YKBNK0826	-10,647,000	-267,599	-0.18

Stress Testi

Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı

