FON RİSK RAPORU

31.12.2024

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

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	24,243,804.58	
Fon Toplam Değeri	16,911,628.41	
Risk Değeri (TRL)	2	
Fon Portföyü Standart Sapması	0.56	

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	18,823,472.50	
Açık Pozisyon Oranı	1.11	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	1.11	Limit : 5,00

RMD Özeti

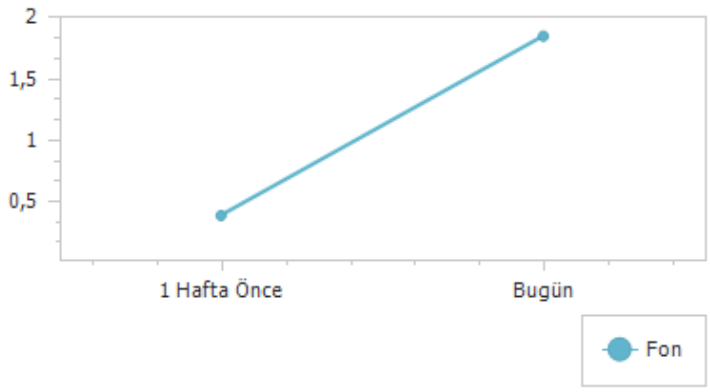
	Fon	Kıstas	Göreli	Limit
RMD	313,881.14			
RMD (%)	1.86			5.59
Beklenen Kayıp	360,572.30			
Beklenen Kayıp (%)	2.13			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

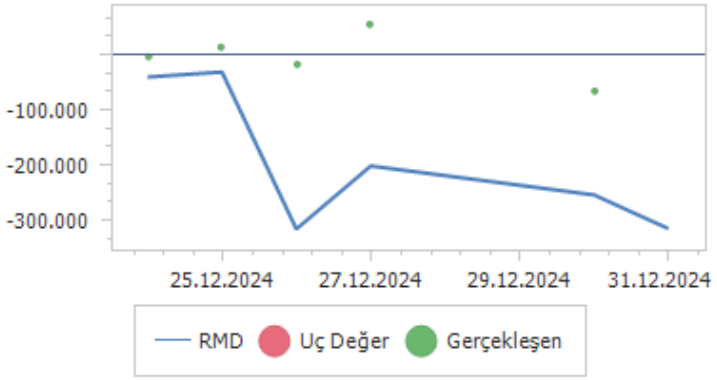
Piyasa	Büyüklük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	215,058	1	0.00
Takasbank Para Piyasası	1,002,679	-3	0.00
Teminat	2,622,067	-51	0.00
Hisse	20,404,000	-352,395	-2.08
Futures	0	-505,627	-2.99

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-18,823,473	-505,627	-2.99
F_XU0300225	-18,823,473	-505,627	-2.99

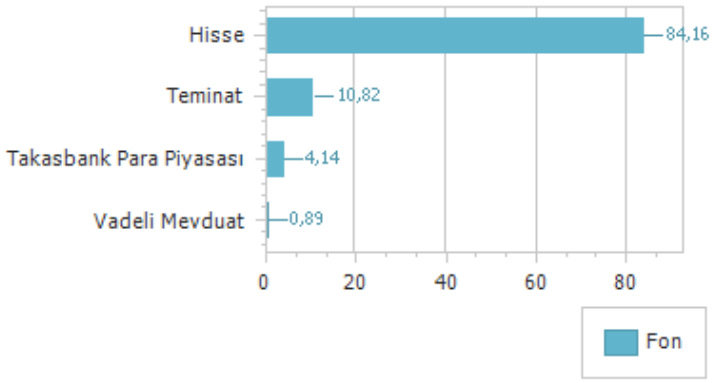
Fon RMD Trendi



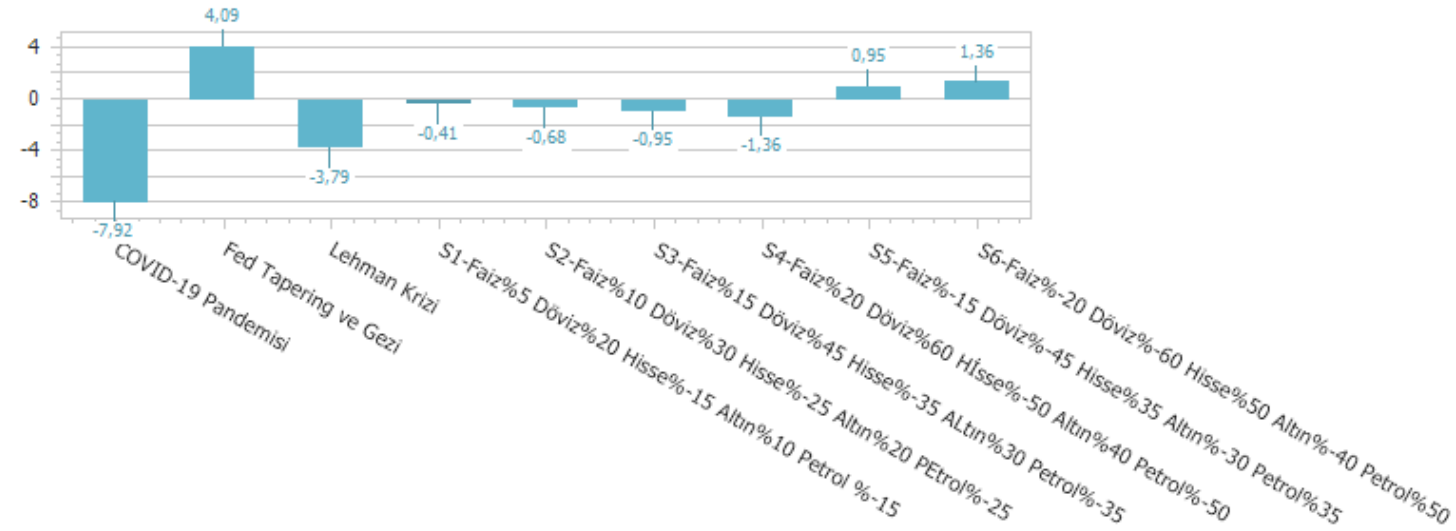
Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi


4
0
-4
-8
4,09
-7,92
-3,79
-0,41
-0,68
-0,95
-1,36
0,95
1,36
COVID-19 Pandemisi
Fed Tapering ve Gezi
Lehman Krizi
S1-Faiz%5 Döviz%20 Hisse%-15 Altın%10 Petrol %-15
S2-Faiz%10 Döviz%30 Hisse%-25 Altın%20 PEtrol%-25
S3-Faiz%15 Döviz%45 Hisse%-35 ALtın%30 Petrol%-35
S4-Faiz%20 Döviz%60 Hİsse%-50 Altın%40 Petrol%-50
S5-Faiz%-15 Döviz%-45 Hisse%35 Altın%-30 Petrol%35
S6-Faiz%-20 Döviz%-60 Hisse%50 Altın%-40 Petrol%50