

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

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	323,598,714.26
Fon Toplam Değeri	370,554,204.75
Risk Değeri (TRL)	2
Fon Portföyü Standart Sapması	0.05

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.00	Limit : 10.00
Kaldıraç Oranı	0.97	Limit : 10.00

RMD Özeti

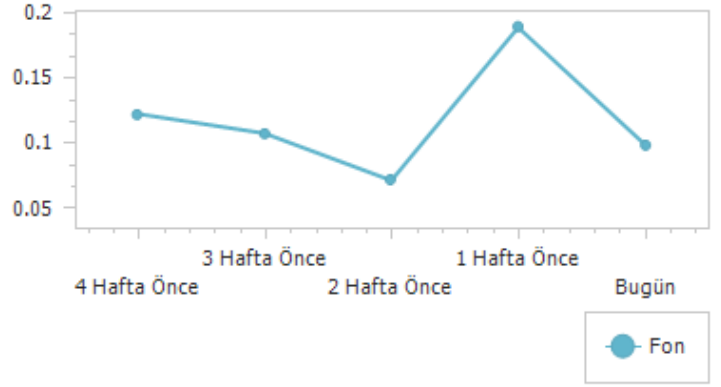
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	368,636.64			
RMD (%)	0.10			
Beklenen Kayıp	423,472.92			
Beklenen Kayıp (%)	0.11			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

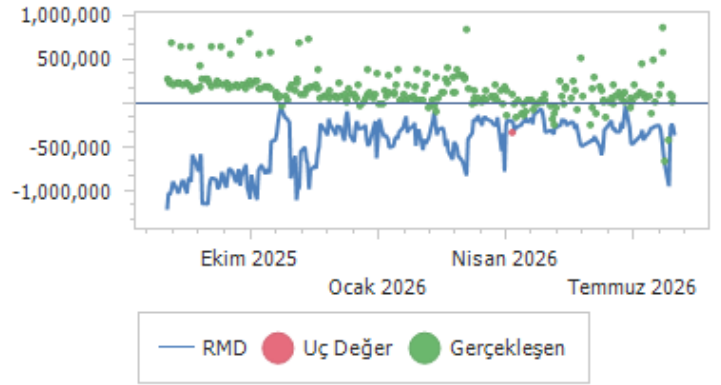
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	977,838	709	0.00
Teminat	59,479,600	-47,242	-0.01
Repo	-48,679,384	-89,319	-0.02
Hisse	311,820,659	-9,499,985	-2.56
Futures	0	-12,685,869	-3.42

Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-360,500,035	-12,710,676	-3.43
Repo-SASA 3 Day(s)	-48,679,384	-89,319	-0.02
F_AKBK0826	-25,081,040	-954,439	-0.26
F_ASELS0826	-29,228,150	-1,692,373	-0.46
F_EKGYO0826	-9,370,512	4,275	0.00
F_EREGL0826	-19,325,922	-632,992	-0.17
F_FROTO0826	-8,010,000	81,938	0.02
F_GARAN0826	-31,220,200	-907,515	-0.24
F_HALKB0826	-19,674,720	-835,223	-0.23
F_ISCTR0826	-27,461,434	-823,851	-0.22
F_KRDMD0826	-2,154,760	46,008	0.01
F_OYAKC0826	-10,622,990	-60,775	-0.02
F_PETKM0826	-9,273,200	-316,969	-0.09
F_PGSUS0826	-1,927,800	67,470	0.02

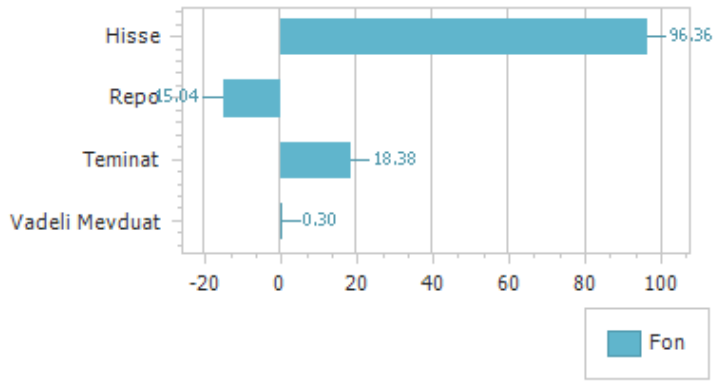
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



F_SAHOL0826	-12,108,850	-4,678	0.00
F_SASA0826	-29,494,023	-1,793,756	-0.48
F_SISE0826	-6,035,604	122,464	0.03
F_THYAO0826	-8,195,400	48,334	0.01
F_TKFEN0826	-9,470,850	-312,968	-0.08
F_TRALT0826	-15,124,800	-711,695	-0.19
F_TTKOM0826	-12,336,900	-89,245	-0.02
F_YKBNK0826	-25,703,496	-1,060,479	-0.29

Stress Testi

