

SFA - Statech Portföy Alpha Serbest Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	300.012.995,06
Fon Toplam Değeri	154.999.061,37
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	0,75

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	99.338.109,30	
Açık Pozisyon Oranı	0,64	Limit :
Kaldıraç Oranı	2,31	Limit : 10,00

RMD Özeti

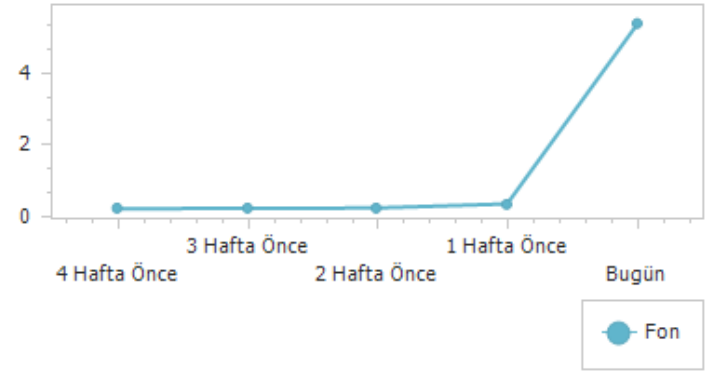
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	8.307.709,61			
RMD (%)	5,36			
Beklenen Kayıp	8.307.709,61			
Beklenen Kayıp (%)	5,36			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

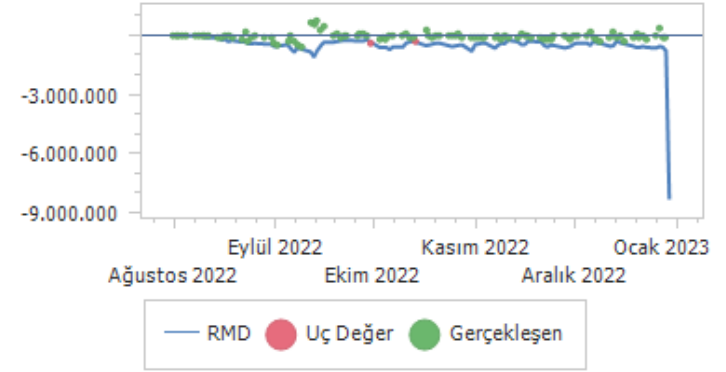
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Teminat	69.773.787	0	0,00
Hisse	230.239.208	-17.238.685	-11,12
Futures	0	-13.670.128	-8,82

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-329.577.317	-13.670.128	-8,82
F_XU0301222	-99.338.109	7.562.256	4,88
F_AEFES0123	-1.219.500	61.018	0,04
F_AEFES0223	-203.250	10.754	0,01
F_AKBNK0123	-1.431.060	146.758	0,09
F_AKBNK0223	-3.084.990	323.886	0,21
F_AKSEN0123	996.400	-17.193	-0,01
F_AKSEN0223	-996.400	17.467	0,01
F_ALARK0123	524.800	-14.393	-0,01
F_ALARK0223	-762.600	21.182	0,01
F_ARCLK0123	-1.065.900	45.667	0,03
F_ARCLK0223	168.300	-7.386	0,00
F_ASELS0123	-10.646.295	969.433	0,63
F_ASELS0223	-2.150.390	200.320	0,13
F_BIMAS0123	13.690	-926	0,00
F_BIMAS0223	-164.280	11.385	0,01
F_DOHOL0123	-6.128.994	421.624	0,27
F_DOHOL0223	131.192	-9.182	-0,01

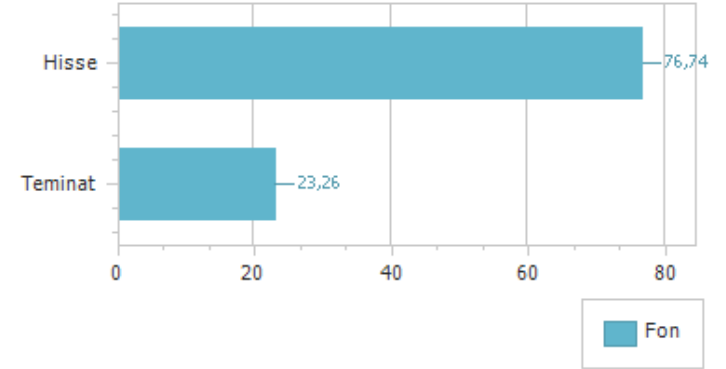
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



F_ECILC0123	-940.824	28.910	0,02
F_ECILC0223	-302.868	9.520	0,01
F_EKGY00123	-8.612.145	853.565	0,55
F_EKGY00223	-1.184.661	120.268	0,08
F_ENJSA0123	-2.282.598	99.316	0,06
F_ENJSA0223	-1.006.074	45.324	0,03
F_EREGL0123	1.592.636	-128.446	-0,08
F_EREGL0223	-1.617.392	133.010	0,09
F_FROTO0123	-524.500	27.410	0,02
F_FROTO0223	-1.888.200	101.440	0,07
F_GARAN0123	-907.208	93.264	0,06
F_GARAN0223	-3.142.184	334.247	0,22
F_GUBRF0123	-13.875.750	622.927	0,40
F_GUBRF0223	-6.158.190	286.309	0,18
F_HALKB0123	-4.387.029	445.749	0,29
F_HALKB0223	-681.777	71.149	0,05
F_HEKTS0123	1.478.466	19.702	0,01
F_HEKTS0223	-1.478.466	-20.321	-0,01
F_ISCTR0123	-5.074.798	524.758	0,34
F_ISCTR0223	-186.442	20.138	0,01
F_ISGYO0123	-328.776	-2.787	0,00
F_ISGYO0223	-184.072	-1.606	0,00
F_KARSN0123	-774.380	31.470	0,02
F_KARSN0223	-761.890	31.838	0,02
F_KCHOL0123	-9.734.310	882.241	0,57
F_KCHOL0223	878.850	-80.522	-0,05
F_KOZAA0123	-611.040	45.900	0,03
F_KOZAA0223	-1.532.960	117.517	0,08
F_KOZAL0123	2.429.500	-154.615	-0,10
F_KOZAL0223	-6.158.500	394.304	0,25
F_KRDMD0123	-7.800.464	653.470	0,42
F_KRDMD0223	-1.707.251	145.080	0,09
F_MGROS0123	-1.128.050	109.313	0,07
F_MGROS0223	234.400	-23.515	-0,02
F_ODAS0123	-9.211.500	511.995	0,33
F_ODAS0223	75.375	-4.272	0,00
F_OYAKC0123	-2.318.506	53.022	0,03
F_OYAKC0223	-750.414	18.128	0,01
F_PETKM0123	-7.944.080	573.043	0,37
F_PETKM0223	-3.952.080	294.008	0,19
F_PGSUS0123	-9.312.000	632.685	0,41
F_PGSUS0223	-2.640.000	184.070	0,12
F_SAHOL0123	-2.186.380	201.162	0,13
F_SAHOL0223	-2.123.268	202.961	0,13
F_SASA0123	2.431.000	-108.853	-0,07
F_SASA0223	-2.431.000	110.500	0,07
F_SISE0123	-19.344.044	1.353.405	0,87
F_SISE0223	-1.802.640	129.731	0,08
F_SKBNK0123	8.262	-324	0,00

F_SKBNK0223	-1.018.674	40.812	0,03
F_SOKM0123	-2.371.008	119.286	0,08
F_SOKM0223	-150.984	7.685	0,00
F_TAVHL0123	-158.950	16.308	0,01
F_TAVHL0223	-570.350	59.952	0,04
F_TCELL0123	-2.776.604	277.638	0,18
F_TCELL0223	-1.500.048	154.941	0,10
F_THYAO0123	-12.934.620	1.344.157	0,87
F_THYAO0223	-9.144.410	981.907	0,63
F_TKFEN0123	-2.280.738	156.334	0,10
F_TKFEN0223	-1.921.140	136.029	0,09
F_TOASO0123	-4.507.040	229.938	0,15
F_TOASO0223	2.336.370	-121.325	-0,08
F_TRGYO0123	-1.493.820	57.833	0,04
F_TRGYO0223	21.230	-837	0,00
F_TSKB0123	-602.623	50.882	0,03
F_TSKB0223	-2.115.517	183.365	0,12
F_TTKOM0123	-2.979.128	210.025	0,14
F_TTKOM0223	61.400	-4.405	0,00
F_TUPRS0123	-5.987.870	617.653	0,40
F_TUPRS0223	-1.960.630	206.472	0,13
F_VAKBN0123	-4.400.489	450.673	0,29
F_VAKBN0223	480.356	-50.442	-0,03
F_VESTL0123	-1.667.250	57.012	0,04
F_VESTL0223	-798.000	28.175	0,02
F_YKBNK0123	-6.272.291	643.104	0,41
F_YKBNK0223	353.119	-37.035	-0,02

Karşı Taraf Riski

Karşı Taraf	Portföyde Bulunan Miktar	Şirketin Portföydeki Ağırlığı
-------------	--------------------------	-------------------------------

Stress Testi

