

100.000	Finansal Varlık 1	Finansal Varlık 2	Finansal Varlık 3	Finansal Varlık 4	Finansal Varlık 5	Finansal Varlık 6	Finansal Varlık 7	Finansal Varlık 8
Varlık Adı	ABC	DEF	GHI	JKL	MNO	PQR	STU	WYZ
Portföy Ağırlığı (%)	20	25		10	35			10
Tutar (TL)	20.000	25.000		10.000	35.000			10.000
Miktar (Adet)	400,00	250,00		33,33	140,00			500,00
Değişim Katsayısı	1,174	1,021	1,258	1,126	1,043	1,326	1,224	1,094
Sharpe Rasyosu	0,206	0,283	0,136	0,279	0,339	0,163	0,198	0,210
Alış Fiyatı	50,00	100,00	160,00	300,00	250,00	182,00	150,00	20,00
Satış Fiyatı								
Getiri Oranı								
Portföyün Getiri Oranı								
Gözlem	ABC	DEF	GHI	JKL	MNO	PQR	STU	WYZ
Alış Günü Fiyat	50,00	100,00	160,00	300,00	250,00	182,00	150,00	20,00
Günlük Getiri 1	5,37	2,09	0,09	1,53	-0,43	1,12	3,78	-0,27
2	-0,70	5,36	2,85	-1,80	5,48	5,53	1,06	2,92
3	1,68	4,57	2,86	5,45	0,32	1,92	-0,65	0,70
4	2,80	4,44	1,94	2,49	-0,71	5,34	4,59	-1,44
5	5,46	3,09	5,28	-0,72	3,79	-1,67	-0,90	5,82
6	-1,89	1,16	2,90	5,65	5,76	-1,36	-0,03	0,48
7	1,63	3,26	4,34	0,32	-1,65	4,29	0,99	2,09
8	3,30	5,77	2,60	-0,92	0,36	2,18	2,04	-0,29
9	4,00	5,12	2,62	-1,79	2,67	2,42	3,39	-0,54
10	2,23	-1,56	5,86	5,62	-1,96	-1,02	-0,42	3,97
91	5,39	3,41	-0,01	4,03	5,52	2,37	4,42	-0,31
92	0,68	-0,81	1,76	1,27	5,11	4,06	5,10	5,65
93	2,74	-1,68	-1,60	-1,42	2,40	3,91	0,98	0,89
94	5,66	3,60	-0,02	5,97	5,27	3,08	1,84	1,65
95	-0,57	3,25	2,40	4,23	2,30	5,87	1,50	3,30
96	-1,60	-0,49	2,45	3,52	5,94	-1,97	5,03	1,17
97	0,08	1,79	0,82	1,90	2,20	-1,05	-1,78	2,75
98	1,02	1,22	3,55	-1,96	3,14	4,96	1,39	5,71
99	0,83	1,55	3,84	2,09	5,53	2,70	0,20	2,22
100	5,76	3,65	3,12	1,20	0,66	-1,16	-1,17	1,41
Günlük Ortalama	1,98	2,11	1,81	2,19	2,32	1,91	1,98	1,95
Standard Sapma	2,321	2,155	2,276	2,463	2,420	2,535	2,422	2,131
Risksiz Faiz oranı* (Günlük)	1,5	1,5	1,5	1,5	1,5	1,5	1,5	1,5

* Risksiz Faiz oranı olarak yıllık devlet tahvilinin 1 günlük faiz oranını kullanınız.