

DAS - Deniz Portföy Onikinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	117,101,603,662.25
Fon Toplam Değeri	116,120,838,524.97
Risk Değeri (TRL)	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.15

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	3,274,308,000.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.03	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.03	Limit : 5,00

RMD Özeti

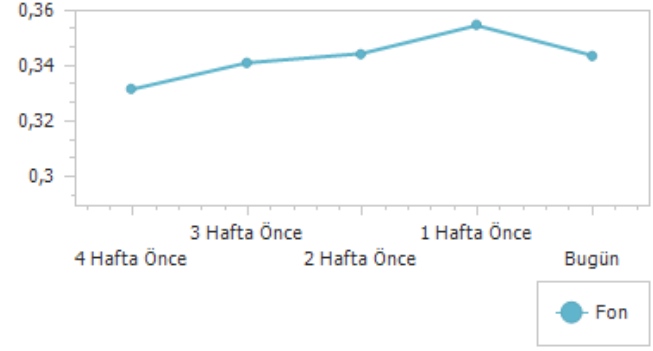
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	399,215,067.95			
RMD (%)	0.34			5.59
Beklenen Kayıp	458,600,019.30			
Beklenen Kayıp (%)	0.39			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

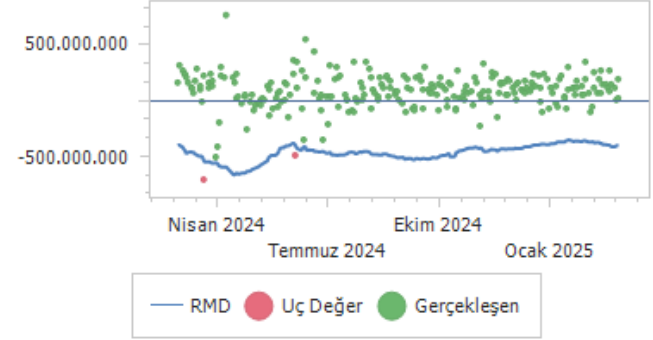
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	30,140,706,306	76,502,388	0.07
Forward	3,125,343	8,675,678	0.01
Ters Repo	46,370,647,960	154,046,407	0.13
Fon	13,566,317,510	45,865,224	0.04
Bono	2,432,658,135	15,420,180	0.01
Eurobond	24,594,126,662	76,651,229	0.07
Nakit	-5,978,253	-22	0.00

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	3,274,308,000	8,675,678	0.01
USD/TRY DAS 36,5003960	3,274,308,000	8,675,678	0.01

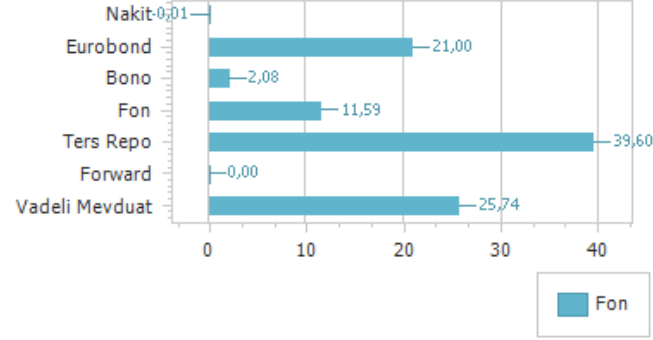
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

