

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	11,692,185,522.55
Fon Toplam Değeri	15,030,042,991.64
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.62

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	3,201,836,550.12	
Açık Pozisyon Oranı	0.21	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.21	Limit : 5,00

RMD Özeti

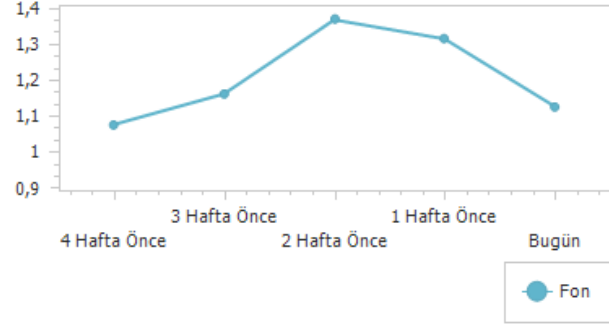
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	169,675,132.71			
RMD (%)	1.13			5.59
Beklenen Kayıp	194,915,035.49			
Beklenen Kayıp (%)	1.30			
Uç Değer Adedi	4			

RMD Kırılımı

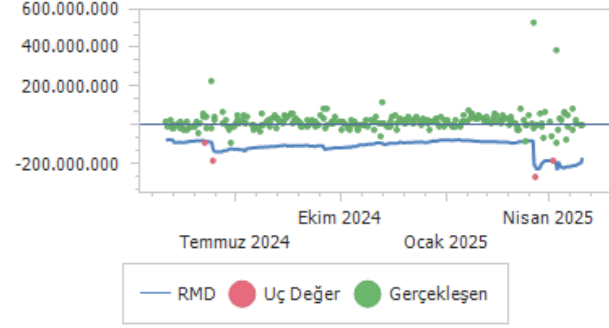
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	2,849,140	18,885	0.00
Repo	-3,201,908,768	869,027	0.01
Fon	1,100,559,957	-609,271	0.00
Eurobond	13,790,685,194	158,859,194	1.06

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-3,201,908,768	869,027	0.01
Repo-XS2730249997 2 Day(s)	-679,489,329	296,609	0.00
Repo-XS2850573374 2 Day(s)	-560,900,116	249,012	0.00
Repo-XS2897383043 2 Day(s)	-297,432,494	136,920	0.00
Repo-XS2911679004 2 Day(s)	-309,329,794	142,169	0.00
Repo-XS2913966318 2 Day(s)	-927,989,380	390,521	0.00
Repo-XS2966430683 2 Day(s)	-350,010,883	159,984	0.00
Repo-XS3013242196 2 Day(s)	-76,756,773	36,377	0.00

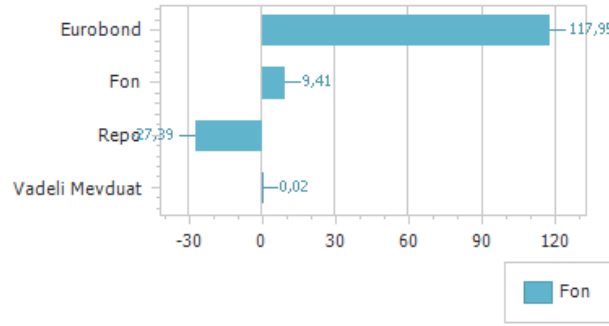
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

