

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	16,534,132,851.02
Fon Toplam Değeri	16,277,206,015.53
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.22

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	2,403,058,352.17	
Açık Pozisyon Oranı	0.15	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.15	Limit : 5,00

RMD Özeti

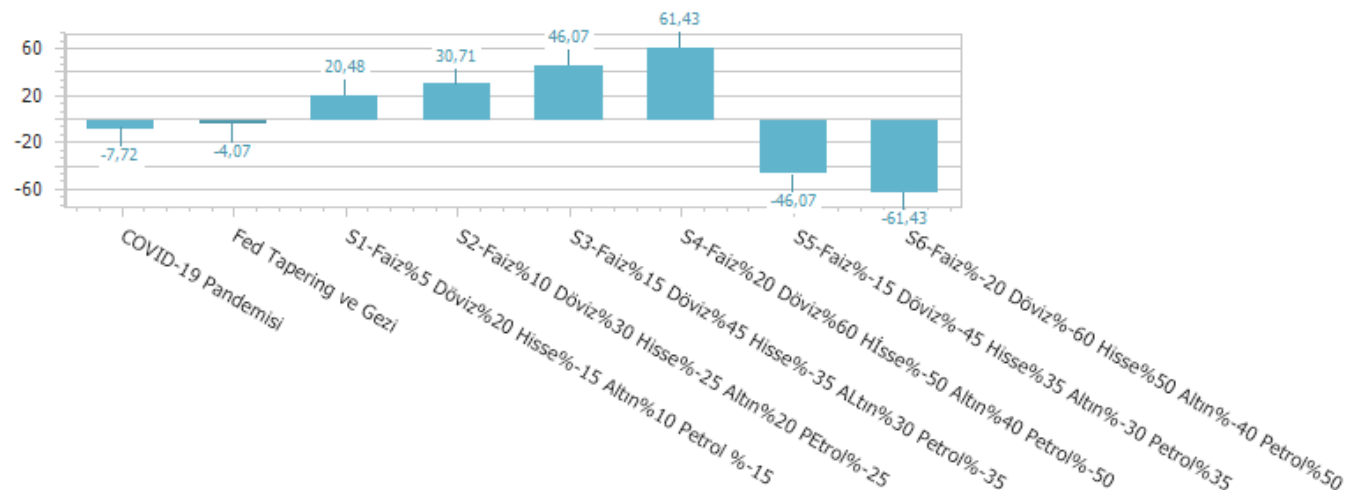
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	85,874,903.76			
RMD (%)	0.53			5.59
Beklenen Kayıp	98,649,163.54			
Beklenen Kayıp (%)	0.61			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

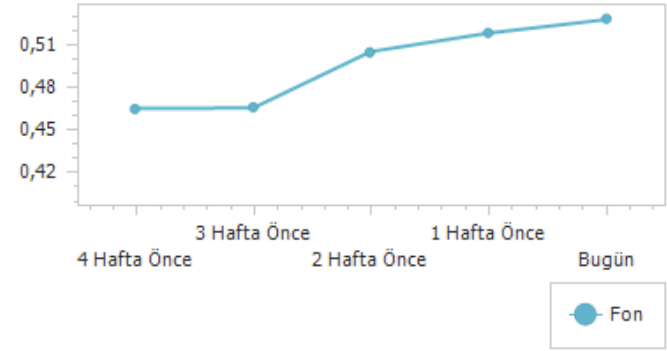
Piyasa	Büyükük	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	3,504,017	5,860	0.00
Repo	-2,403,755,345	-4,473,091	-0.03
Fon	2,009,736,106	2,247,207	0.01
Eurobond	16,924,648,073	82,651,865	0.51

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-2,403,755,345	-4,473,091	-0.03
Repo-XS2678233243 3 Day(s)	-882,760,279	-1,474,452	-0.01
Repo-XS2730249997 3 Day(s)	-627,144,384	-1,026,683	-0.01
Repo-XS2741069996 3 Day(s)	-724,453,724	-1,195,169	-0.01
Repo-XS2861686041 3 Day(s)	-169,396,957	-267,108	0.00

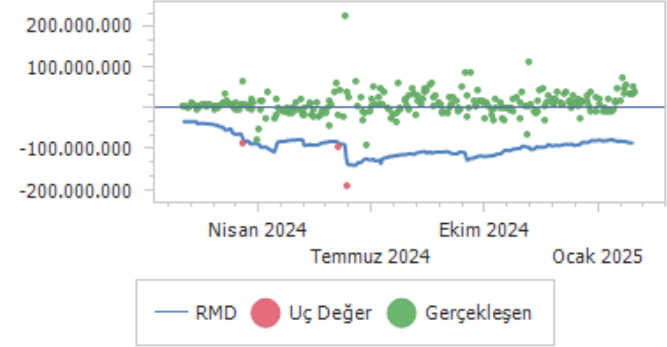
Stress Testi



Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı

