

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	11,434,537,074.46
Fon Toplam Değeri	11,378,076,907.02
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.17

Kaldıraç Yaratın İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	4,341,527,808.47	
Açık Pozisyon Oranı	0.38	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	1.20	Limit : 5.00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	44,387,495.51			
RMD (%)	0.39			5.59
Beklenen Kayıp	50,990,325.60			
Beklenen Kayıp (%)	0.45			
Uç Değer Adedi	2			

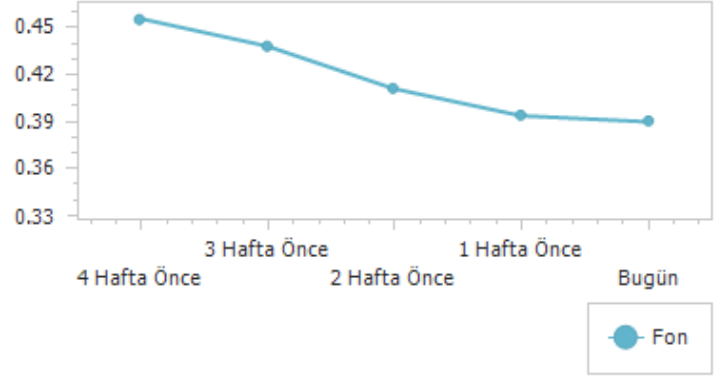
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	54,711,698	2,777	0.00
Teminat	1,548,539,478	-328,483	0.00
Hisse	185,002,000	3,173,872	0.03
Fon	128,206,725	37,885	0.00
Bono	197,042,317	287,790	0.00
Eurobond	9,321,034,858	11,360,266	0.10
Futures	0	-7,246,739	-0.06

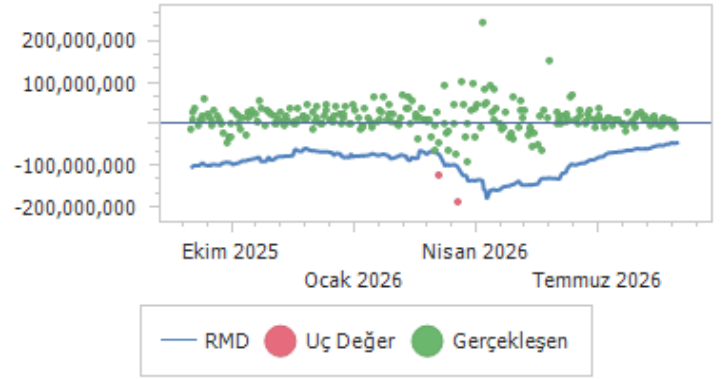
Kaldıraç Yaratın İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-13,667,201,999	-7,246,739	-0.06
F_USDTRY0826	-13,667,201,999	-7,246,739	-0.06

Stress Testi

Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı

