

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	15,335,479,560.99
Fon Toplam Değeri	15,223,950,432.97
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.24

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	2,735,146,270.67	
Açık Pozisyon Oranı	0.18	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.18	Limit : 5.00

RMD Özeti

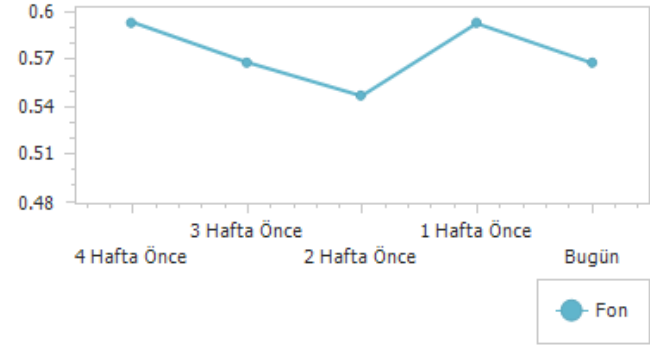
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	86,492,183.67			
RMD (%)	0.57			5.59
Beklenen Kayıp	99,358,266.47			
Beklenen Kayıp (%)	0.65			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

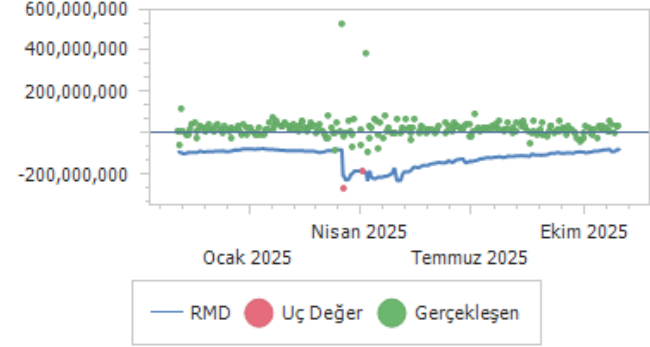
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Hisse	142,600,000	1,528,830	0.01
Fon	3,414,369,896	9,588,682	0.06
Eurobond	14,511,352,386	61,226,431	0.40
Vadeli Mevduat	2,472,492	4,493	0.00
Repo	-2,735,315,212	-1,837,752	-0.01

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-2,735,315,212	-1,837,752	-0.01
Repo-US900123DK30 3 Day(s)	-420,124,636	-174,044	0.00
Repo-XS2730249997 3 Day(s)	-994,050,511	-475,938	0.00
Repo-XS2861686041 3 Day(s)	-1,036,586,820	-501,246	0.00
Repo-XS2915523661 3 Day(s)	-284,553,245	-113,531	0.00

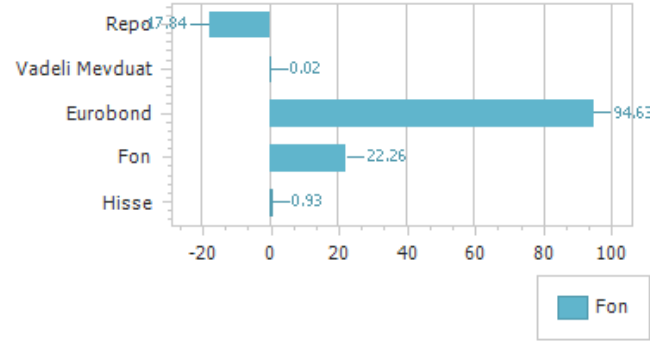
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

