

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	16,445,020,091.64
Fon Toplam Değeri	16,280,748,289.48
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.28

Kaldıraç Yaratıcı İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	2,360,146,787.80	
Açık Pozisyon Oranı	0.14	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.14	Limit : 5,00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	108,347,405.47			
RMD (%)	0.67			5.59
Beklenen Kayıp	124,464,546.12			
Beklenen Kayıp (%)	0.76			
Uç Değer Adedi	3			

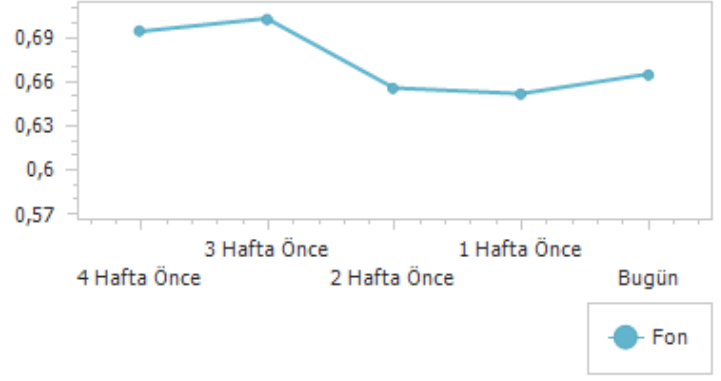
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	3,665,424	8,574	0.00
Repo	-2,360,159,284	-2,318,042	-0.01
Fon	1,512,949,020	762,604	0.00
Bono	229,639,520	587,150	0.00
Eurobond	17,058,925,412	103,462,536	0.64

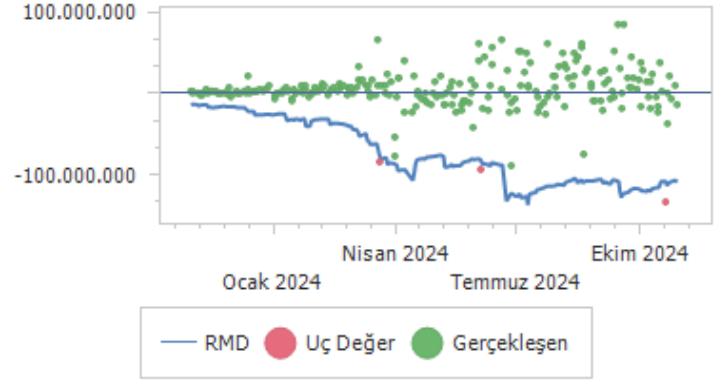
Kaldıraç Yaratıcı İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-2,360,159,284	-2,318,042	-0.01
Repo-USG95448AC32 1 Day(s)	-475,142,502	-356,360	0.00
Repo-XS1623796072 1 Day(s)	-99,814,108	-70,170	0.00
Repo-XS2445343689 1 Day(s)	-159,805,122	-113,546	0.00
Repo-XS2677517497 1 Day(s)	-158,779,635	-112,797	0.00
Repo-XS2750476603 1 Day(s)	-150,404,821	-106,690	0.00
Repo-XS2764457235 1 Day(s)	-616,147,021	-472,958	0.00
Repo-XS2861686041 1 Day(s)	-700,066,075	-544,697	0.00

Stress Testi

Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı

