

DPB - Deniz Portföy Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	2,979,660,545.45
Fon Toplam Değeri	2,375,109,218.54
Risk Değeri (TRL)	7
Fon Portföyü Standart Sapması	0.33

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	1,465,286,706.08	
Açık Pozisyon Oranı	0.62	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.62	Limit : 5,00

RMD Özeti

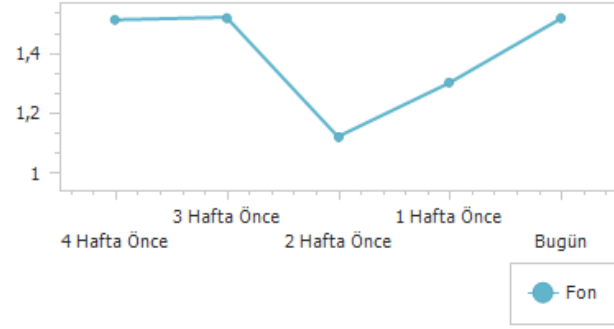
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	36,058,669.00			
RMD (%)	1.52			5.59
Beklenen Kayıp	41,801,538.32			
Beklenen Kayıp (%)	1.76			
Uç Değer Adedi	0			

RMD Kırılımı

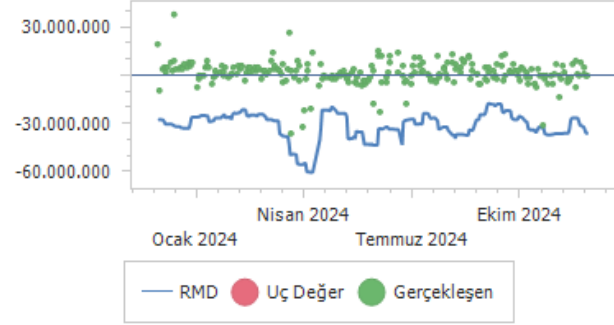
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	2,264,830	5,297	0.00
Repo	-1,465,295,055	1,980,495	0.08
Fon	243,547,204	-303,335	-0.01
Eurobond	4,199,143,566	28,956,787	1.22

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-1,465,295,055	1,980,495	0.08
Repo-USM88269US88 3 Day(s)	-16,949,825	22,909	0.00
Repo-XS1617531063 3 Day(s)	-117,783,986	159,197	0.01
Repo-XS2445343689 3 Day(s)	-310,804,440	420,084	0.02
Repo-XS2677517497 3 Day(s)	-49,811,730	67,326	0.00
Repo-XS2678232781 3 Day(s)	-21,619,674	29,221	0.00
Repo-XS2678233243 3 Day(s)	-248,366,820	335,693	0.01
Repo-XS2741069996 3 Day(s)	-296,276,018	400,447	0.02
Repo-XS2850573374 3 Day(s)	-50,157,645	67,793	0.00
Repo-XS2913966318 3 Day(s)	-353,524,916	477,825	0.02

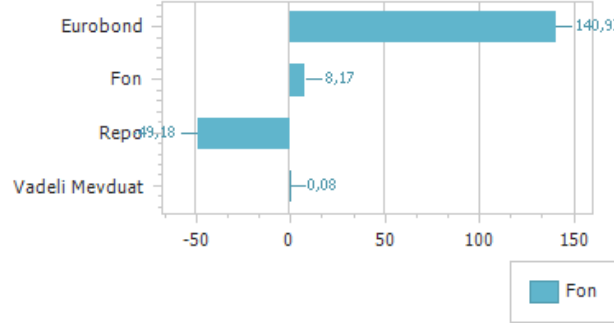
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

