

DAS - Deniz Portföy Onikinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	108,528,331,499.10
Fon Toplam Değeri	108,461,848,622.97
Risk Değeri (TRL)	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.16

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	3,880,833,000.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.04	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.04	Limit : 5,00

RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	392,437,911.13			
RMD (%)	0.36			5.59
Beklenen Kayıp	450,814,731.38			
Beklenen Kayıp (%)	0.42			
Uç Değer Adedi	2			

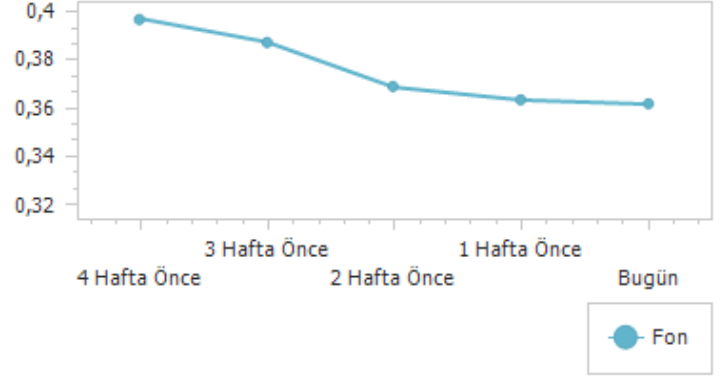
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	25,146,285,887	78,971,457	0.07
Forward	-1,986,874	12,439,750	0.01
Ters Repo	38,179,559,825	114,791,160	0.11
Fon	15,467,576,557	41,734,123	0.04
Bono	2,520,591,848	19,931,802	0.02
Eurobond	27,220,761,512	103,795,801	0.10
Nakit	-4,457,256	-22	0.00

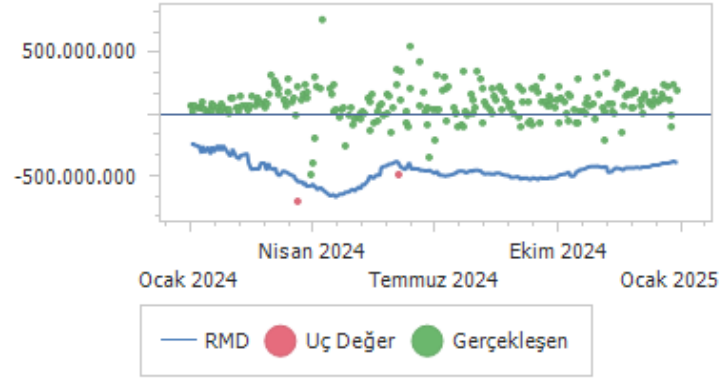
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	3,880,833,000	12,439,750	0.01
USD/TRY DAS 35,365344	3,880,833,000	12,439,750	0.01

Stress Testi

Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı

