

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon
Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	13,057,896,735.30
Fon Toplam Değeri	13,012,964,634.66
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.19

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	0.00	
Açık Pozisyon Oranı	0.00	Limit : 1.00
Kaldıraç Oranı	0.45	Limit : 5.00

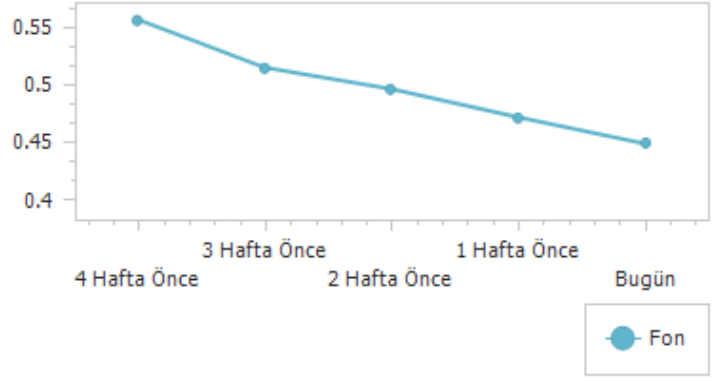
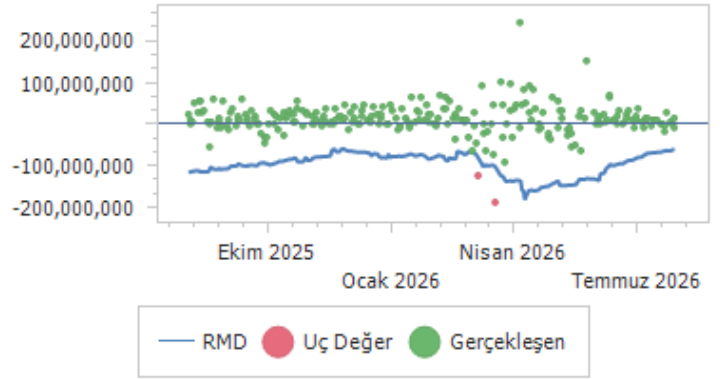
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	58,576,577.27			
RMD (%)	0.45			5.59
Beklenen Kayıp	67,290,094.04			
Beklenen Kayıp (%)	0.52			
Uç Değer Adedi	2			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	2,417,374	1,560	0.00
Teminat	656,846,643	88,068	0.00
Forward	150,055	-19,944	0.00
Hisse	81,026,250	510,473	0.00
Fon	124,825,055	61,456	0.00
Bono	190,505,430	589,662	0.00
Eurobond	12,001,909,319	43,846,028	0.34
Futures	0	-4,347,492	-0.03
Nakit	216,610	3	0.00

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-5,895,803,066	-4,395,651	-0.03
USD/TRY DZM 48.795	-47,345,200	-19,944	0.00
F_USDTRY0726	-1,914,592,543	-1,004,124	-0.01
F_USDTRY0826	-3,933,865,323	-2,564,113	-0.02

Stress Testi
Fon RMD Trendi

Geriye Dönük Test

Fon Varlık Kırılımı
