

DZM - Deniz Portföy Beşinci Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	20,840,391,953.66
Fon Toplam Değeri	18,765,878,912.01
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.20

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	534,554,679.92	
Açık Pozisyon Oranı	0.03	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.03	Limit : 5,00

RMD Özeti

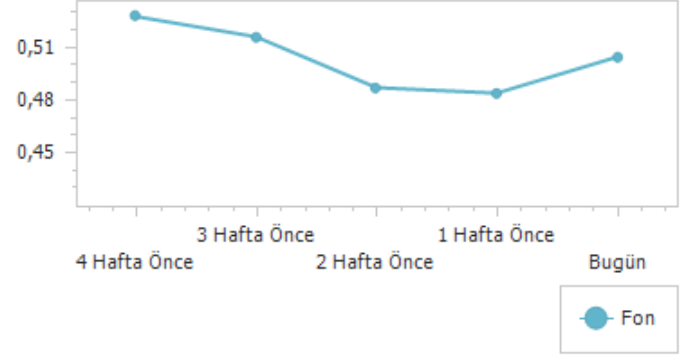
	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	94,696,162.73			
RMD (%)	0.50			5.59
Beklenen Kayıp	108,782,622.56			
Beklenen Kayıp (%)	0.58			
Uç Değer Adedi	3			

RMD Kırılımı

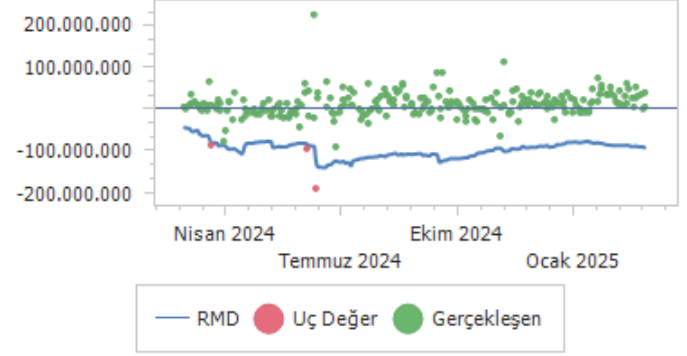
Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	3,831,704	7,874	0.00
Repo	-534,994,850	-1,417,111	-0.01
Fon	2,076,215,415	4,749,659	0.03
Eurobond	19,295,339,686	86,639,249	0.46

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	-534,994,850	-1,417,111	-0.01
Repo-XS2730249997 3 Day(s)	-534,994,850	-1,417,111	-0.01

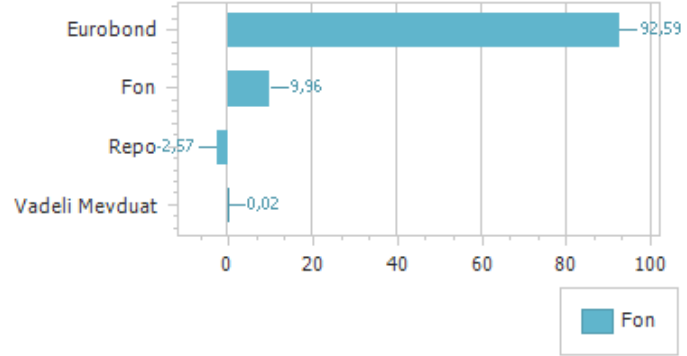
Fon RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı



Stress Testi

