

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

Fon Portföy Değeri	153,454,893.39
Fon Toplam Değeri	152,166,277.01
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	0.85

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	41,257,568.95	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	0.27	Limit : 5,00

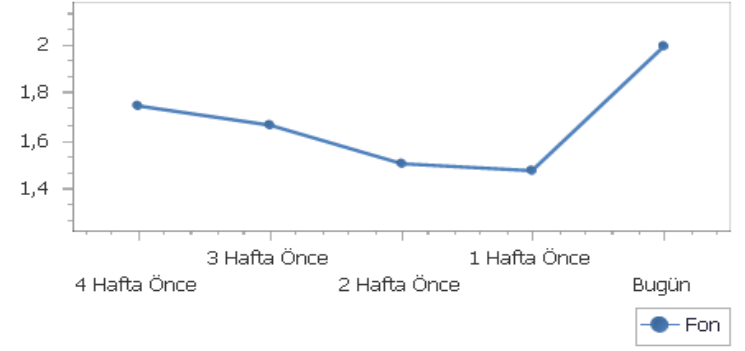
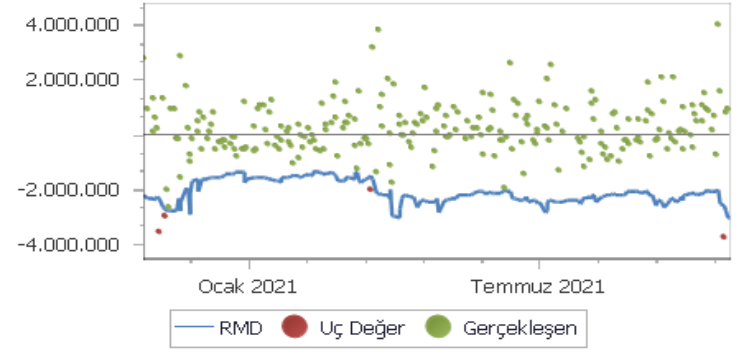
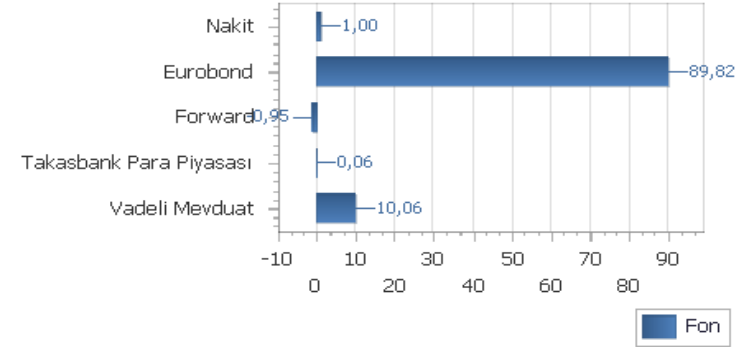
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	3,037,058.64			
RMD (%)	2.00			5.59
Beklenen Kayıp	3,488,834.12			
Beklenen Kayıp (%)	2.29			
Uç Değer Adedi	4			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	15,444,043	303,986	0.20
Takasbank Para Piyasası	90,099	67	0.00
Forward	-1,452,374	12,890	0.01
Eurobond	137,837,694	2,703,142	1.78
Nakit	1,535,432	280	0.00

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	19,261,569	12,890	0.01
EUR/USD 1,1915 48310	-10,998,000	13,201	0.01
EURUSD 1,1827 48377	9,481,300	-309	0.00

Fon RMD Trendi

Geriye Dönük Test

Fon Varlık Kırılımı

Stress Testi
