

DFM - Deniz Portföy Özel Sektör Borçlanma Araçlarına Yatırım Yapan %100 Anapara Koruma Amaçlı İkinci Fon
Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	11,390,280.56
Fon Toplam Değeri	11,396,576.19
Risk Değeri	5
Fon Portföyü Standart Sapması	1.55

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	12,925,544.50	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	1.13	Limit : 1,00

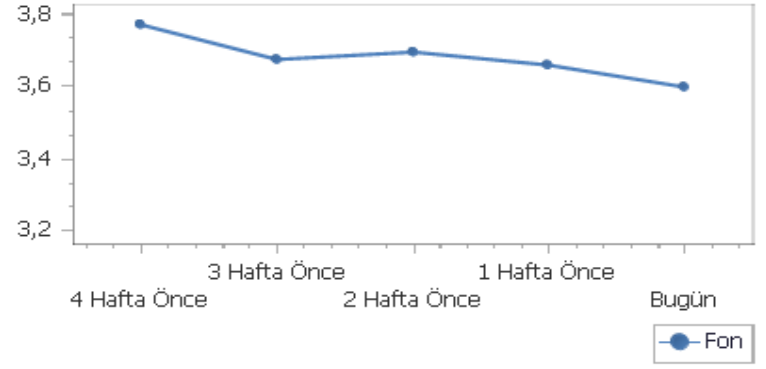
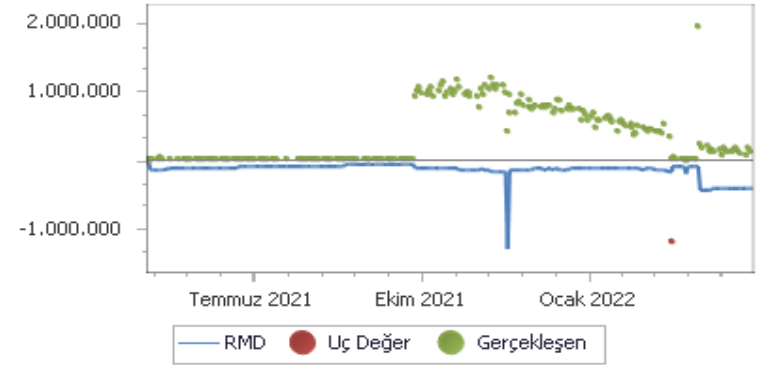
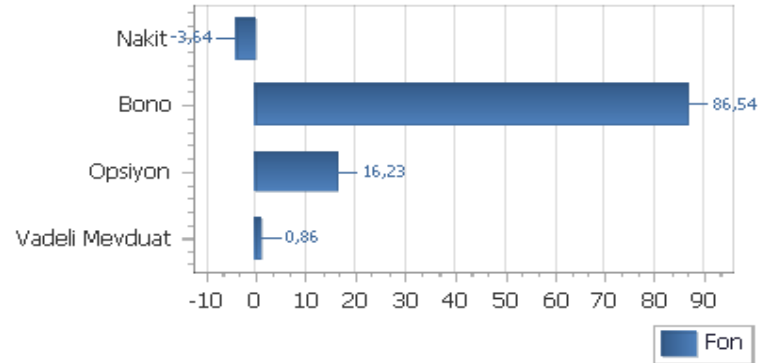
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	409,922.95			
RMD (%)	3.60			5.59
Beklenen Kayıp	470,900.75			
Beklenen Kayıp (%)	4.13			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	98,039	178	0.00
Opsiyon	1,849,091	313,220	2.75
Bono	9,857,371	105,392	0.92
Nakit	-414,221	-738	-0.01

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	12,925,544	313,220	2.75
SPDR GOLD OPT.	12,925,544	313,220	2.75

Fon RMD Trendi

Geriye Dönük Test

Fon Varlık Kırılımı

Stress Testi
