

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

Fon Portföy Değeri	11,305,076.53
Fon Toplam Değeri	11,319,759.59
Risk Değeri	7
Fon Portföyü Standart Sapması	1.37

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

Açık Pozisyon Tutarı	12,033,613.55	
Açık Pozisyon Oranı	1.06	Limit : 1,00
Kaldıraç Oranı	1.06	Limit : 1,00

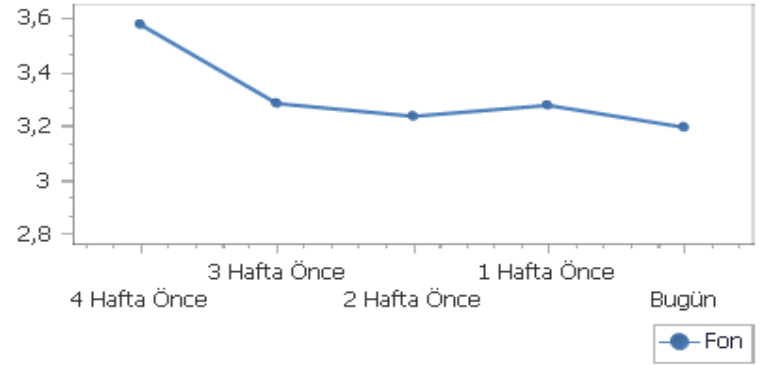
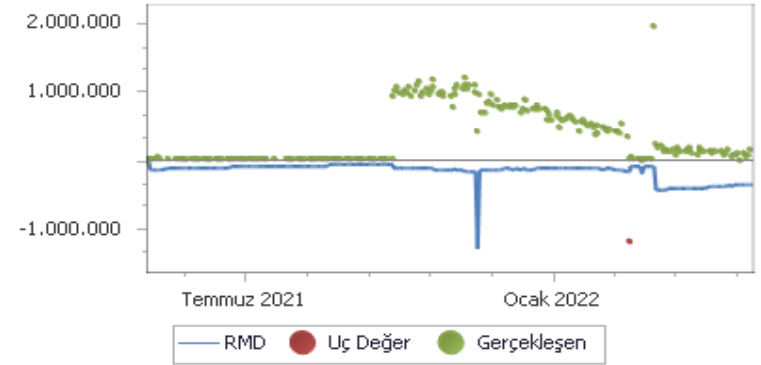
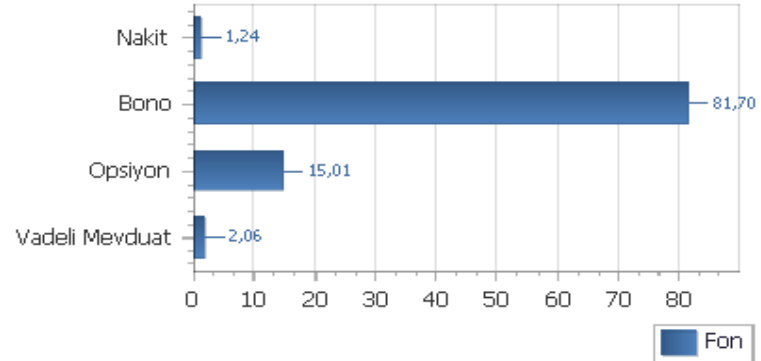
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	361,441.31			
RMD (%)	3.19			5.59
Beklenen Kayıp	415,207.25			
Beklenen Kayıp (%)	3.67			
Uç Değer Adedi	1			

RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Vadeli Mevduat	232,549	340	0.00
Opsiyon	1,696,604	250,898	2.22
Bono	9,235,819	73,517	0.65
Nakit	140,104	210	0.00

Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)
Toplam	12,033,614	250,898	2.22
SPDR GOLD OPT.	12,033,614	250,898	2.22

Fon RMD Trendi

Geriye Dönük Test

Fon Varlık Kırılımı

Stress Testi
