

DUD - Deniz Portföy Uzun Vadeli Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	449,985,836.28
Fon Toplam Değeri	449,388,411.55
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.51
Fon Kıstası	%10 BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat USD (TL) + %60 BIST-KYD Kamu Eurobond 5-15 Yıl USD (TL) + %30 BIST-KYD Kamu Eurobond 15+ Yıl USD (TL)

Kaldıraç Yaratan İşlemler Bilgisi

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

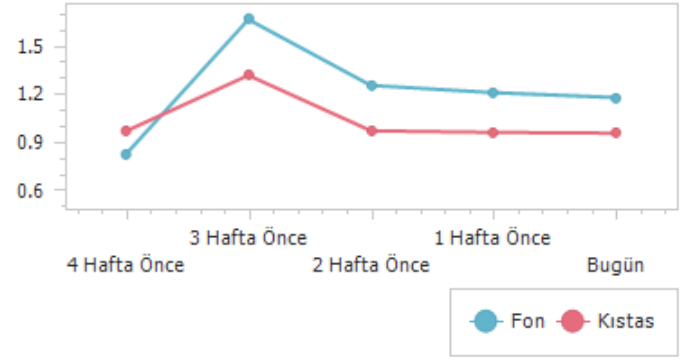
RMD Özeti

	Fon	Kıstas	Görelî	Limit
RMD	5,321,991.43	4,325,819.62	1.23	2.00
RMD (%)	1.18	0.96	1.23	
Beklenen Kayıp	6,113,660.45	4,969,303.82	1.23	
Beklenen Kayıp (%)	1.36	1.11	1.23	
Uç Değer Adedi	1			

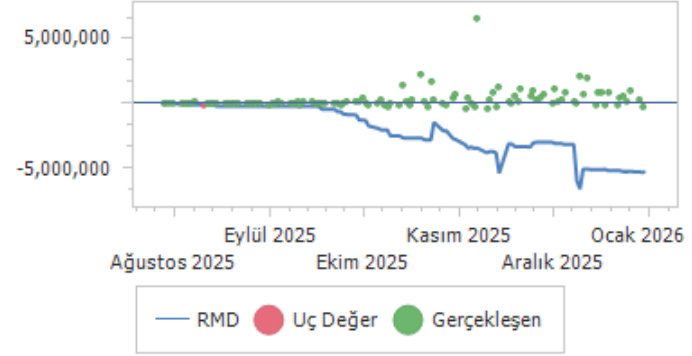
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Eurobond	442,910,459	5,279,423	1.17
Vadeli Mevduat	7,075,377	13,695	0.00
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)

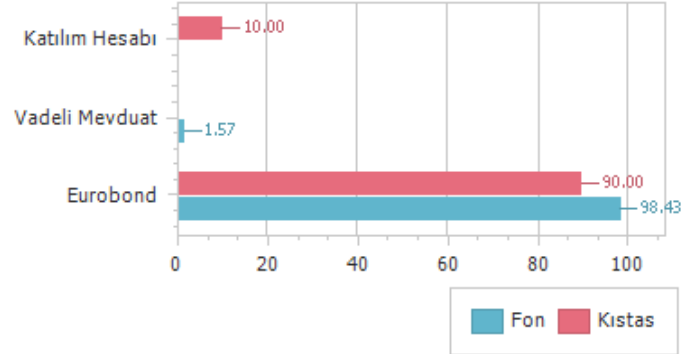
Fon ve Kıstas RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı ve Kıstas Karşılaştırması



Stress Testi

