

DUD - Deniz Portföy Uzun Vadeli Serbest (Döviz) Fon

Fon Bilgileri

Fon Portföy Değeri	360,713,448.27
Fon Toplam Değeri	358,557,642.10
Risk Değeri (TRL)	6
Fon Portföyü Standart Sapması	0.36
Fon Kistası	%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

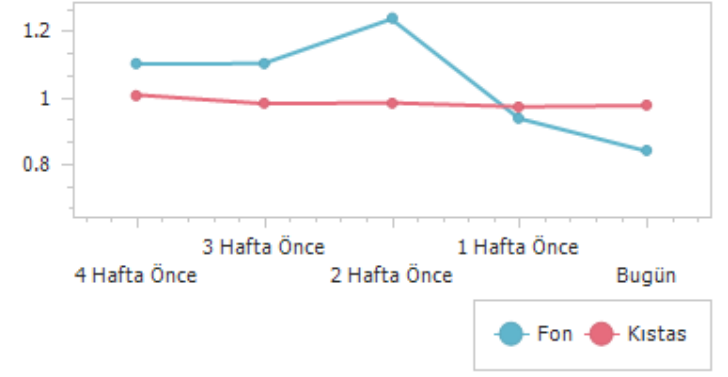
RMD Özeti

	Fon	Kistas	Görelî	Limit
RMD	3,020,608.50	3,512,107.47	0.86	2.00
RMD (%)	0.84	0.98	0.86	
Beklenen Kayıp	3,469,936.96	4,034,548.50	0.86	
Beklenen Kayıp (%)	0.97	1.13	0.86	
Uç Değer Adedi	1			

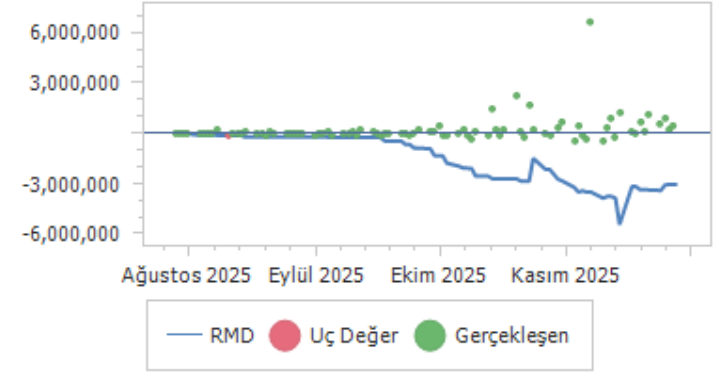
RMD Kırılımı

Piyasa	Büyüklik	Artık RMD	Artık RMD (%)
Eurobond	356,420,067	2,995,092	0.84
Vadeli Mevduat	4,293,382	14,271	0.00
Kaldıraç Yaratan İşlemler	Sözleşme Büyüklüğü	Artık RMD	Artık RMD (%)

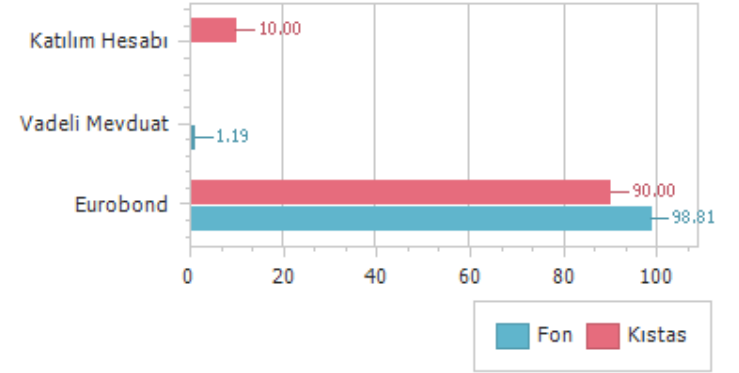
Fon ve Kistas RMD Trendi



Geriye Dönük Test



Fon Varlık Kırılımı ve Kistas Karşılaştırması



Stress Testi

