

26/06/2012

**DENİZBANK A.Ş. KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI
%100 ANAPARA KORUMA AMAÇLI B TİPİ ÖZEL SEKTÖR
BORÇLANMA ARAÇLARINA YATIRIM YAPAN İMKB 30
ENDEKSİNİN YÜKSELECEĞİNİ ÖNGÖREN ONÜÇÜNCÜ ALT
FONU**

**1. İHRAÇ KATILMA PAYLARININ
TASARRUF SAHİPLERİNE DUYURUDUR.
(KESİNLEŞEN PORTFÖY DAĞILIMI)**

Fonun talep toplama dönemi **22/06/2012** tarihinde sona ermiş olup fon portföyü **25/06/2012** tarihinde oluşturulmuştur. Fon içtüzüğü'nün Fonun Yatırım Amacı ve Portföy Yönetim Stratejisi başlıklı 7 No.lu maddesi uyarınca duyurulması gereken kesinleşen bilgilere aşağıda yer verilmektedir.

Talep Toplama Dönemi : 18/06/2012- 22/06/2012

Yatırım Dönemi Başlangıç ve Bitiş Tarihleri:

Yatırım Dönemi Başlangıç : 25/06/2012

Yatırım Dönemi Sonu : 17/05/2013

Portföy Oluşturma Tarihi : **25/06/2012**

Kesinleşen Portföy Dağılımı Bilgileri

Özel Sektör Tahvili (Banka Borçlanma Aracı) : %85.72

Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesi : %5.96

İMKB Ters Repo : %8.32

Opsiyon Sözleşmesinin Karşı Tarafı : **BNP Paribas SA**

Fon Toplam Değeri : 5.929.938,27- TL

Dolaşımdaki Pay Sayısı : 593.400.000 adet pay

Fon Fiyatı : 0.009993

Katılımcı Sayısı(Müşteri sayısı) : 1.426 kişi

Opsiyon iştirak oranı : **%53.96**

Getiri Hesaplamasında Baz Alınacak Endeksin Başlangıç Değeri: 72.153,53

Alt fonun yatırım amacı, fonun yatırım dönemi sonunda katılma payı sahiplerinin anaparalarının tamamını korumak ve borsa dışından alınacak bir opsiyon sözleşmesi ile İMKB 30 endeksindeki artışı belli bir getiriye katılım oranı (yaklaşık %50) doğrultusunda yararlanmalarını sağlamaktır. Anaparanın korunması amacıyla yönelik olarak, alt fon portföyünün yaklaşık % 93'ü ile TRSDZBK51315 ISIN kodlu 15/05/2013 vadeli Denizbank tahviline (Banka Tahvili) yatırım yapılacaktır. Alt fon bu izahnamede belirtilen vade sonuna kadar katılma paylarını elinde tutan

yatırımcılara anapara koruması sağlama amacındadır. Anapara koruması getiri amaçlı olarak portföye dahil edilecek opsiyon sözleşmesinin getirisinden bağımsızdır.

Örnek Hesaplama:

İMKB 30 Endeks Getirisi =
(İMKB 30 Endeks vade sonu fiyatı / İMKB 30 Endeks başlangıç fiyatı) -1

Dayanak Varlık Getirisi (Opsiyon Getirisi) =
Max [0, İMKB 30 Endeks Getirisi]

Fonun Vade Sonu Değeri =
Anapara * [1+ (Dayanak varlık getirisi * Getiriye Katılım Oranı)]

**DENİZBANK A.Ş. KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI
%100 ANAPARA KORUMA AMAÇLI B TİPİ ÖZEL SEKTÖR
BORÇLANMA ARAÇLARINA YATIRIM YAPAN İMKB 30
ENDEKSİNİN YÜKSELECEĞİNİ ÖNGÖREN ONÜÇÜNCÜ ALT FONU**

FİGEN KILIÇ ERGÜZEL
FON KURULU ÜYESİ

FATİH ARABACIOĞLU
FON KURULU ÜYESİ