

10/09/2012

DENİZBANK A.Ş.
KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI %100
ANAPARA KORUMA AMAÇLI B TİPİ ÖZEL SEKTÖR
BORÇLANMA ARAÇLARINA YATIRIM YAPAN PETROLÜN
YÜKSELECEĞİNİ ÖNGÖREN ONDÖRDÜNCÜ ALT FONU

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

Fonun talep toplama dönemi **07/09/2012** tarihinde sona ermiş olup fon portföyü **10/09/2012** 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 : 03/09/2012- 07/09/2012

Yatırım Dönemi Başlangıç ve Bitiş Tarihleri:

Yatırım Dönemi Başlangıcı : 10/09/2012

Yatırım Dönemi Sonu : 19/07/2013

Portföy Oluşturma Tarihi : **10/09/2012**

Kesinleşen Portföy Dağılımı Bilgileri

Özel Sektör Tahvili (Banka Borçlanma Aracı) : %0

Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesi : %4.30

İMKB Ters Repo : %95.70

Opsiyon Sözleşmesinin Karşı Tarafı : **CİTİBANK , NEW YORK**

Fon Toplam Değeri : 6.744.830,20- TL

Dolaşımdaki Pay Sayısı : 674.900.000 adet pay

Fon Fiyatı : 0,009994

Katılımcı Sayısı(Müşteri sayısı) : 1.613 kişi

Fon Yönetim Ücreti : **0.005479 günlük karşılık ayrılmaktadır.**

Özel Sektör Borçlanma Aracının Karşı Tarafı : **Denizbank A.Ş.**

Faiz oranı :8.17% basit, %8,22 bileşik
Faiz oranının hesaplanma şekli : İlgili vadedeki gösterge devlet tahvili olan TRT170713T17 ISIN kodlu DİBS'in 5-6-7 Eylül 2012 tarihlerinde İMKB Tahvil Bono piyasasında oluşan ortalama bileşik getirileri alınmış ve bu üç tarihteki bileşik faizin ortalaması üzerine +0,90 ek getiri ilave edilerek faiz oranı hesaplanmıştır.

Opsiyon iştirak oranı : %53.37

Getiri Hesaplamasında Baz Alınacak Endeksin Başlangıç Değeri (Brent cinsi ham petrolün Amerikan Doları cinsinden varil fiyatının başlangıç değeri): 114.81 USD/Barrel

Örnek Hesaplama:

Dayanak Varlık Getirisi (Opsiyon Getirisi) =

Max (0 , (Brent Ham Petrol vade sonu değeri / Brent Ham Petrol başlangıç değeri) – 1)

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
PETROLÜN YÜKSELECEĞİNİ ÖNGÖREN
ONDÖRDÜNCÜ ALT FONU**

**FİGEN KILIÇ ERGÜZEL
FON KURULU ÜYESİ**

**FATİH ARABACIOĞLU
FON KURULU ÜYESİ**