

DENİZBANK A.Ş.
KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI %100 ANAPARA KORUMA
AMAÇLI B TİPİ ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARINA YATIRIM
APABİLEN EURO STOXX 50 ENDEKSİNİN YÜKSELECEĞİNİ ÖNGÖREN
ONALTINCI ALT FONU1. İHRAÇ KATILMA PAYLARININTASARRUF
SAHİPLERİNE DUYURUDUR.

(KESİNLEŞEN PORTFÖY DAĞILIMI)

Fonun talep toplama dönemi **08/02/2013** tarihinde sona ermiş olup fon portföyü **11/02/2013** 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 : 04/02/2013- 08/02/2013

Yatırım Dönemi Başlangıç ve Bitiş Tarihleri:

Yatırım Dönemi Başlangıç : 11/02/2013

Yatırım Dönemi Sonu : 14/03/2014

Portföy Oluşturma Tarihi : **11/02/2013**

Kesinleşen Portföy Dağılımı Bilgileri

Özel Sektör Tahvili (Banka Borçlanma Araçları) : %0

Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesi : %4.43

İMKB Ters Repo : %95.57

Opsiyon Sözleşmesinin Karşı Tarafı : BNP Paribas SA

Fon Toplam Değeri : 3.654.170,61- TL

Dolaşımdaki Pay Sayısı : 365.900.000 adet pay

Fon Fiyatı : 0.009987

Katılımcı Sayısı(Müşteri sayısı) : 86 kişi

Fon Yönetim Ücreti Komisyon oranı: Fon yönetim ücreti günlük %0,004110 (yüzbindedörtvirgülyüzon) yıllık %1.50(birnoktaelli) oranında olacaktır. Fon'un yatırım dönemi 396 gün olup, yıllık oran 365 gün üzerinden hesaplanmıştır. Fon Tebliğ'in 49/A maddesi "**Fonlara uygulanan ücret ve komisyonların kamuya açıklanması ve fon toplam giderinin üst sınırının belirlenmesi**" ile ilgili olarak ,Fondan karşılanacak **tüm giderlerin (yönetim ücreti dahil)** toplamının üst sınırı, günlük %0,006 (yüzbindealtı) (yıllık %2,19)'dur.

3, 6, 9 ve 12 aylık dönemlerin son işgünü itibarıyla, söz konusu gider oranının ilgili döneme denk gelen kısmının aşılmadığı, ilgili dönem için hesaplanan günlük ortalama fon toplam değeri esas alınarak, kurucu tarafından kontrol edilir. Yapılan kontrolde gider oranının aşıldığının tespiti halinde aşan tutar ilgili dönemi takip eden 5 iş günü içinde kurucu tarafından alt fona iade edilir. İade edilen tutar, ilgili yıl içinde takip eden dönemlerin toplam gider oranı hesaplamasında toplam giderlerden düşülür. Gider oranına ilişkin kontroller, alt fon katılma paylarının satışa

sunulmuş olduğu günler dikkate alınarak yapılır.3, 6, 9 ve 12 aylık dönemlerin bitiminde hesaplanan fon toplam gider oranı ve varsa iade tutarı ilgili dönemin bitimini takip eden 6 iş günü içinde KAP'ta ilan edilir.

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

Faiz Oranı : 6,63% basit, %6,62 bileşik

Faiz oranının hesaplanma şekli : Fon portföyüne alınacak DenizBank A.Ş.Tahvili için T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlık'ının ihraç ettiği 24 Eylül 2014 vadeli devlet tahvili gösterge kıymet olarak dikkate alınacaktır. Fon'un halka arz tarihinin son 3 iş gününde gösterge DİBS için gerçekleşen işlem ağırlıklı bileşik faizlerinin aritmetik ortalaması Denizbank A.Ş. Tahvili için gösterge bileşik faiz olarak belirlenecektir. Bu bileşik faiz oranı kullanılarak Denizbank A.Ş. tahvili için geçerli olacak gösterge basit faiz oranı hesaplanacaktır. DenizBank A.Ş. tarafından verilecek ek faiz oranı %0,90 olup, gösterge basit faiz oranına eklenerek DenizBank Banka Tahvili'nin basit faiz oranı hesaplanacaktır. Tahvilin ihraç ve vade başlangıç tarihi 25/02/2013, İtfa tarihi ise 12/03/2014 dur. 11/02/2013 - 25/02/2013 tarihleri arasında tahvil alımı için ayrılan kısım %6,42 basit, %6,62 bileşik faiz oranı ile 14 günlük repo yapılmıştır.

Opsiyon İştirak oranı : **%88.39**

Getiri Hesaplamasında Baz Alınacak Endeksin Başlangıç Değeri (Euro Stoxx 50 endeksinin başlangıç değeri): 2.622,61

Örnek Hesaplama:

Euro Stoxx 50 Endeks Getirisi =

(Euro Stoxx 50 Endeks vade sonu fiyatı / Euro Stoxx 50 Endeks başlangıç fiyatı) -1

Dayanak Varlık Getirisi (Opsiyon Getirisi) =

Min [20%, Max (0, Euro Stoxx 50 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 KORUMAAMAÇLI B TİPİ
ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARINA YATIRIM APABİLEN EURO STOXX 50
ENDEKSİNİN YÜKSELECEĞİNİ ÖNGÖREN ONALTINCI ALT FONU

FİĞEN KILIÇ ERGÜZEL
FON KURULU ÜYESİ

FATİH ARABACIOĞLU
FON KURULU ÜYESİ