

10/04/2012

**DENİZBANK A.Ş.'NİN  
KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI %102 ANAPARA KORUMA  
AMAÇLI B TİPİ DOLAR TL KURUNUN DÜŞECEĞİNİ ÖNGÖREN  
ONBİRİNCİ ALT FONU'NUN 1. İHRAÇ KATILMA PAYLARININ  
TASARRUF SAHİPLERİNE DUYURUDUR.**

**\*\*\*KESİNLEŞEN PORTFÖY DAĞILIMI \*\*\***

Fonun talep toplama dönemi **06/04/2012** tarihinde sona ermiş olup fon portföyü **10/04/2012** tarihinde oluşturulmuştur. Fon içtüzüğünün Fonun Yatırım Amacı ve Portföy Yönetim Stratejisi başlıklı 7 No.lu maddesi uyarınca duyurulması gereken kesinleşen bilgilere aşağıda yer verilmektedir.

**Talep Toplama Dönemi** : 28/03/2012- 06/04/2012

**Yatırım Dönemi Başlangıç ve Bitiş Tarihleri:**

Yatırım Dönemi Başlangıç : 10/04/2012

Yatırım Dönemi Sonu : 22/03/2013

**Portföy Oluşturma Tarihi** : **10/04/2012**

**Kesinleşen Portföy Dağılımı Bilgileri**

Devlet İç Borçlanma Senedi : %89,93

Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesi : %4,16

İMKB Ters Repo : %5,91

**Opsiyon Sözleşmesinin Karşı Tarafı : **Denizbank****

Fon Toplam Değeri : 3.425.136,15- TL

Dolaşımdaki Pay Sayısı : 342.500.000 adet pay

Fon Fiyatı : 0.010000

Katılımcı Sayısı(Müşteri sayısı) : 930 kişi

**Opsiyon İştirak oranı : **%248.17****

**Getiri Hesaplamasında Baz Alınacak Endeksin Başlangıç Değeri: 1,8014 USD TL Kuru**

Alt fonun yatırım amacı, fonun yatırım dönemi sonunda katılma payı sahiplerinin anaparalarının tamamını korumak ve her halükarda anaparalarına vade sonunda %2 sabit getiri sağlamak ve bu sabit getiriye ek olarak borsa dışından alınacak bir opsiyon sözleşmesi ile USDTRY kurundaki düşüştüden belli bir getiriye katılım oranı doğrultusunda yararlanmalarını sağlamaktır.

Anaparanın korunması ve % 2'lik sabit getiri amacına yönelik olarak, alt fon portföyünün yaklaşık % 96'sı ile devlet iç borçlanma senetlerine ve/veya ters repoya yatırım yapılacaktır. Alt fon bu izahnamede belirtilen vade sonuna kadar katılma paylarını elinde tutan yatırımcılara anapara koruması sağlama amacındadır. Anapara koruması ve vade sonunda %2'lik sabit getiri, getiri amaçlı olarak portföye dahil edilecek opsiyon sözleşmesinin getirisinden bağımsızdır.

**ÖRNEK HESAPLAMA :**

**Opsiyon Getirisi**=  $\text{Max} ( 0 , 1 - ( \text{USDTRY vade sonu değeri} / \text{USDTRY başlangıç değeri} ) )$

**Fonun Vade Sonu Değeri** =  $\text{Anapara} * [ \% 102.00 + (\text{Opsiyon Getirisi} * \text{GKO}) ]$

**DENİZBANK A.Ş.  
KORUMA AMAÇLI ŞEMSİYE FONU'NA BAĞLI % 102 ANAPARA  
KORUMA AMAÇLI B TİPİ DOLAR TL KURUNUN DÜŞECEĞİNİ  
ÖNGÖREN ONBİRİNCİ ALT FONU**

SUNA UZUN  
FON KURUL ÜYESİ

FATİH ARABACIOĞLU  
FON KURUL ÜYESİ