

DENİZBANK A.Ş.
KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI %100 ANAPARA
KORUMA AMAÇLI B TİPİ DENİZBANK LÜKS ENDEKSİ'NİN
YÜKSELECEĞİNİ ÖNGÖREN ONSEKİZİNCİ ALT FONU'NUN 1. İHRAÇ
KATILMA PAYLARININ TASARRUF SAHİPLERİNE DUYURUDUR.

(KESİNLEŞEN PORTFÖY DAĞILIMI)

Fonun talep toplama dönemi **15/11/2013** tarihinde sona ermiş olup fon portföyü **18/11/2013** 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 :11/11/2013- 15/11/2013

Yatırım Dönemi Başlangıç ve Bitiş Tarihleri:

Yatırım Dönemi Başlangıç : 18/11/2013
Yatırım Dönemi Sonu : 21/11/2014

Portföy Oluşturma Tarihi : **18/11/2013**

Kesinleşen Portföy Dağılımı Bilgileri

Devlet Tahvili : %86,43
Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesi : %6,32
İMKB Ters Repo : %7,25

Opsiyon Sözleşmesinin Karşı Tarafı : **SOCIETE GENERALE SA**

Fon Toplam Değeri : 17.956.843,22- TL

Dolaşımdaki Pay Sayısı : 1.795.100.000 adet pay

Fon Fiyatı : 0.010003

Katılımcı Sayısı(Müşteri sayısı) : 398 kişi

Fon Yönetim Ücreti Komisyon oranı: Fon yönetim ücreti günlük %0,002740 (yüzbindeikivirgülyetmişdört) yıllık %1,00 (yüzdebir) oranında olacaktır. Fon'un yatırım dönemi 369 gün olup, yıllık oran 365 gün üzerinden hesaplanmıştır.

Yönetim ücreti, her işgünü sonunda yapılan değerlendirme sonucunda bulunan fon toplam değerinin matrah olarak kabul edilmesiyle günlük olarak tahakkuk ettirilir. Tatil günleri için ise, tatil öncesindeki işgünüdeki fon toplam değeri üzerinden o işgünü ve tatil olan gün sayısı kadar karşılık tutarının tatil öncesindeki işgününde toplu olarak tahakkuk ettirilir ve her ay sonunu izleyen bir hafta içinde Kurucu'ya ve Yönetici'ye ödenir. Bu ücretin % 70'i Denizbank A.Ş., %30'u ise Deniz Portföy Yönetim A.Ş. tarafından paylaşılacaktır. Yatırım dönemi sonunda, yatırımcılara ödemenin yapılmasını izleyen en geç 2 işgünü içinde Kurucu'ya ve Yönetici'ye ödeme yapılır.

Fon Tebliğinin 49/A maddesi "**Fonlara uygulanan ücret ve komisyonların kamuya açıklanması ve fon toplam giderinin üst sınırının belirlenmesi**" ile ilgili olarak ,Fondan

karşılacak **tüm giderlerin (yönetim ücreti dahil)** toplamının üst sınırı, günlük %0,006 (yüzbindealtı) (yıllık %2,19)'dur.

Opsiyon İştirak oranı : %130.87

Getiri Hesaplamasında Baz Alınacak Endeks: Denizbank Luxury Risk-Control 10% Excess Return TRY Index (Bloomberg Ticker: SGMDDLRC Index)

Getiri Hesaplamasında Baz Alınacak Endeks Başlangıç Değeri: 1,026.94

Örnek Hesaplama:

- Endeks getirisi aşağıdaki formül ile hesaplanacaktır;

$$\mathbf{Endeks\ Getirisi} = \frac{\mathbf{Endeks\ Vade\ Sonu\ Değeri}}{\mathbf{Endeks\ Başlangıç\ Değeri}} - \mathbf{1}$$

- Opsiyon Getirisi ise endeks getirisi kullanılarak aşağıdaki şekilde hesaplanacaktır;

$$\mathbf{Opsiyon\ Getirisi} = \max (0, \mathbf{Endeks\ Getirisi})$$

- Buna göre fonun vade sonu değeri ise aşağıdaki şekilde olacaktır;

$$\mathbf{Fon\ Vade\ Sonu\ Değeri} = \mathbf{Anapara} \times (1 + \mathbf{Opsiyon\ Getirisi} \times \mathbf{Getiriye\ Katılım\ Oranı})$$

DENİZBANK A.Ş.

Suna UZUN
Fon Kurulu Üyesi

Fatih ARABACIOĞLU
Fon Kurulu Üyesi