

T.C. ZİRAAT BANKASI A.Ş.’NİN KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU’NA BAĞLI B TİPİ %100 ANAPARA KORUMA AMAÇLI ÜÇÜNCÜ ALT FONU KATILMA BELGESİ SAHİPLERİNE DUYURUDUR

Talep toplama dönemi 09.12.2011 tarihinde sona ermiş olup fon portföyü 12.12.2011 tarihinde oluşturulmuştur. Fon izahnamesinin “ALT FONUN YATIRIM AMACI ve PORTFÖY YÖNETİM STRATEJİSİ” başlıklı maddesinde belirtildiği üzere kesinleşen portföy dağılımı ve getiriye katılım oranı aşağıda duyurulmaktadır.

Yatırım Dönemi Başlangıç ve Bitiş Tarihleri:

Yatırım Dönemi Başlangıcı : 12.12.2011

Yatırım Dönemi Sonu : 07.11.2012

Kesinleşen Portföy Dağılımı:

Devlet İç Borçlanma Senedi : %92,23

İMKB Ters Repo : %0,80

Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesi : %6,97

Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesinin Karşı Tarafı: BNP Paribas.

Getiri Hesaplamasında Kullanılacak Olan Opsiyonun Bilgileri:

Dayanak Varlık: “USD/TRY” Kuru

Dayanak Varlığın Başlangıç Değeri: 1,8455

ABD Dolar kurunun (USD/TRY) günlük fiyat sabitlemesi bilgilerine, Avrupa Merkez Bankası (ECB) tarafından belirlenen ve Avrupa merkezi saatiyle (CET) saat 14:15’ten sonra Reuters “ECB37” sayfasında ilan edilen EUR/TRY ve EUR/USD çapraz kurları kullanılarak ulaşılabilmektedir. Avrupa Merkez Bankası tarafından ilan edilen kurlar 1 Euro karşılığı açıklandığı için, USD/TRY kuru değerine, EUR/TRY ve EUR/USD pariteleri kullanılarak çapraz kur hesaplamasıyla ulaşılabilecektir.

Getiriye Katılım Oranı: %261,01

Fon Yönetim Ücreti:

Yıllık %1,5 - Günlük %0,004110

