

# T.C. ZİRAAT BANKASI A.Ş.'NİN KORUMA AMAÇLI ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI B TİPİ %100 ANAPARA KORUMA AMAÇLI BİRİNCİ ALT FONU KATILMA PAYI SAHİPLERİNE DUYURUDUR.

Talep toplama dönemi 28.01.2011 tarihinde sona ermiş olup fon portföyü 31.01.2011 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 : 31.01.2011

Yatırım Dönemi Sonu : 25.01.2012

## Kesinleşen Portföy Dağılımı:

Devlet İç Borçlanma Senedi : %92,79

İMKB Ters Repo : %1,76

Borsa Dışı Opsiyon Sözleşmesi : %5,45

Getiriye Katılım Oranı : %54,59

## Getiri Hesaplamasında Kullanılacak Olan Opsiyon Bilgileri:

Altının Amerikan Doları Cinsinden Ons Fiyatı (XAUUSD) : 1319,00

Opsiyon Quanto bir opsiyon (bu opsiyonlarda, opsiyonun getirisi temel alınan kur (TL) üzerinden hesaplanır ve aynı kur üzerinde ödeme yapılır) olduğu için yatırımcı kur riski taşımamaktadır.

Altının Amerikan Doları cinsinden ons fiyatının (XAUUSD) günlük fiyat sabitlemesi bilgileri, The London Gold Market Fixing Ltd. tarafından açıklanmaktadır ve Reuters "GOFO" ile Bloomberg "GOLDLNPM" sayfalarından görülebilmektedir. Yayımlanan bilgiler, Altının Amerikan Doları cinsinden ons fiyatının (XAUUSD) sabah (yaklaşık Londra saati ile 10:30) ve akşamüstü (yaklaşık Londra saati ile 15:00) fiyat sabitlemesini göstermektedir. Opsiyon getirisi hesaplaması için saat 15:00 sabitlemesi kullanılacaktır.

## Fon Yönetim Ücreti:

Yıllık %1,5 / Günlük %0,004110

