

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 HESAP DÖNEMİNE AİT
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA
UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR



**KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. Katılım Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. Katılım Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.


Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 24 Nisan 2020

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul		İhraççı	Vade	Kar Payı	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Net	Günlük					
Kıymet	Döviz Cinsi	Kurum	Tarihi	Oran	Değer	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Dönüş	Birim	Toplam	Grup	Toplan	Toplam	
						Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Tutar	Değer	Değer	(%)	(FPD göre)	(FTD göre)	
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
ALKA	TL	ALKA			600,000.00	4.569275	26/12/19		2,741,565.00		5.580000	3,348,000.00	3.28	0.44		0.45
ALKA	TL	ALKA			20,000.00	5.597500	30/12/19		111,950.00		5.580000	111,600.00	0.11	0.02		0.01
ALKIM	TL	ALKIM			221,166.00	24.842771	09/12/19		5,494,376.29		38.320000	8,475,081.12	8.31	1.12		1.13
ASELS	TL	ASELS			625,000.00	19.896234	11/12/19		12,435,146.25		20.940000	13,087,500.00	12.83	1.72		1.75
BIMAS	TL	BIMAS			190,000.00	44.917874	30/12/19		8,534,396.06		46.660000	8,865,400.00	8.69	1.17		1.19
		DESPEC BILGISAYAR														
DESPC	TL	PAZARLAMA VE TICARET A.Ş.			1,000,000.00	3.284030	30/12/19		3,284,030.00		4.240000	4,240,000.00	4.16	0.56		0.57
EGEEN	TL	EGEEN			10,000.00	466.746858	05/12/19		4,667,468.58		580.500000	5,805,000.00	5.69	0.77		0.78
EGEEN	TL	EGEEN			1,231.00	580.422421	31/12/19		714,500.00		580.500000	714,595.50	0.70	0.09		0.10
EGSER	TL	EGSER			400,000.00	3.478192	26/12/19		1,391,276.80		3.710000	1,484,000.00	1.45	0.20		0.20
ENKAI	TL	ENKAI			0.15	5.000000	04/09/18		0.75		6.420000	0.96	0.00	0.00		0.00
EREGL	TL	EREGL			2,000,000.00	7.766331	30/12/19		15,532,662.00		9.040000	18,080,000.00	17.74	2.38		2.42
EREGL	TL	EREGL			700,000.00	9.058214	31/12/19		6,340,749.80		9.040000	6,328,000.00	6.20	0.83		0.85
FROTO	TL	FROTO			6,000.00	54.335252	09/09/19		326,011.51		70.850000	425,100.00	0.42	0.06		0.06
		HALK GAYRİMENKUL														
HLGYO	TL	YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			6,000,000.00	1.043535	30/12/19		6,261,210.00		1.220000	7,320,000.00	7.18	0.96		0.98
		HALK GAYRİMENKUL														
HLGYO	TL	YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			1,000,000.00	1.215000	31/12/19		1,215,000.00		1.220000	1,220,000.00	1.20	0.16		0.16
ISDMR	TL	ISDMR			600,000.00	6.878211	30/12/19		4,126,926.60		8.010000	4,806,000.00	4.71	0.63		0.64
ISDMR	TL	ISDMR			50,000.00	8.009000	31/12/19		400,450.00		8.010000	400,500.00	0.39	0.05		0.05
KNFRT	TL	KNFRT			650,000.00	7.343534	30/12/19		4,773,297.10		7.820000	5,083,000.00	4.98	0.67		0.68
NUHCM	TL	NUHCM			1.00	9.310000	28/08/18		9.31		11.880000	11.88	0.00	0.00		0.00
ORGE	TL	ORGE ENERJİ ELEKTRİK			1,150,000.00	4.129365	30/12/19		4,748,769.75		4.960000	5,704,000.00	5.59	0.75		0.76
ORGE	TL	ORGE ENERJİ ELEKTRİK			80,022.00	4.943516	31/12/19		395,590.04		4.960000	396,909.12	0.39	0.05		0.05
SELEC	TL	SELEC			800,000.00	4.556604	26/12/19		3,645,283.20		6.100000	4,880,000.00	4.78	0.64		0.65
SELEC	TL	SELEC			200,000.00	6.153500	31/12/19		1,230,700.00		6.100000	1,220,000.00	1.20	0.16		0.16
SODA	TL	SODA			0.91	3.604396	26/07/18		3.28		6.180000	5.62	0.00	0.00		0.00
GRUP TOPLAMI					16,303,421.06				88,371,372.32			101,994,704.20	100.00	13.43		13.64
GRUP TOPLAMI					16,303,421.06				88,371,372.32			101,994,704.20	100.00	13.43		13.64

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	Döviz Cinsi	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Kar Payı Oranı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutar	Günlük Birim Deger	Toplam Deger	Grup (%)	Toplan (FPD göre)	Toplam (FTD göre)
KATILIM HESABI															
EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		02/01/20	11.25	6,570,000.00		02/12/19			6,632,775.00	11.250000	6,632,775.00	13.77	0.87	0.89
EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		03/01/20	11.75	16,100,000.00		27/11/19			16,291,766.44	11.750000	16,286,583.56	33.82	2.15	2.18
EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		06/01/20	11.25	9,600,000.00		28/11/19			9,715,397.26	11.250000	9,703,561.64	20.15	1.28	1.30
EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		06/01/20	11.25	2,730,000.00		05/12/19			2,756,926.03	11.250000	2,753,560.27	5.72	0.36	0.37
EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		07/01/20	11.50	2,500,000.00		06/12/19			2,525,205.48	11.500000	2,521,267.12	5.24	0.33	0.34
VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		13/02/20	10.00	10,250,000.00		30/12/19			10,376,369.86	10.000000	10,258,424.66	21.30	1.35	1.37
GRUP TOPLAMI					47,750,000.00							48,156,172.25	100.00	6.34	6.45
GRUP TOPLAMI					47,750,000.00							48,156,172.25	100.00	6.34	6.45
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
TRD120220T16	TL	HAZINE	12/02/20	0.00	15,750,000.00	100.104100	26/12/19	9.454941	15,766,395.75		105.286107	16,582,561.86	2.73	2.19	2.22
TRD230920T24	TL	HAZINE	23/09/20	0.00	64,480,000.00	101.360600	13/11/19	10.176468	65,357,314.88		116.510845	75,126,192.64	12.33	9.93	10.06
TRD181120T19	TL	HAZINE	18/11/20	0.00	20,100,000.00	100.036100	13/11/19	10.538588	20,107,256.10		108.375485	21,783,472.46	3.58	2.87	2.92
TRD100221T17	TL	HAZINE	10/02/21	0.00	59,510,000.00	100.659800	24/12/19	10.971968	59,902,646.98		113.885953	67,773,530.55	11.14	8.93	9.07
TRD160621T17	TL	HAZINE	16/06/21	0.00	43,700,000.00	107.793800	18/12/19	9.957325	47,105,890.60		116.027336	50,703,946.00	8.33	6.68	6.79
TRD140721T18	TL	HAZINE	14/07/21	0.00	36,900,000.00	89.107200	18/12/19	9.87891	32,880,556.80		104.050708	38,394,711.19	6.31	5.06	5.14
TRD220921T16	TL	HAZINE	22/09/21	0.00	30,980,000.00	104.487000	28/11/19	1.807375	32,370,072.60		156.447625	48,467,474.23	7.97	6.39	6.49
TRD151221T10	TL	HAZINE	15/12/21	0.00	72,680,000.00	100.712600	23/12/19	10.115485	73,197,917.68		103.349555	75,114,456.59	12.35	9.90	10.05
TRD100822T10	TL	HAZINE	10/08/22	0.00	16,370,000.00	99.268400	18/12/19	10.021908	16,250,237.08		106.414671	17,420,081.70	2.86	2.30	2.33
TRD070623T16	TL	HAZINE	07/06/23	0.00	700,000.00	129.580700	28/11/19	2.737921	907,064.90		130.631234	914,418.64	0.15	0.12	0.12
TRD301024T10	TL	HAZINE	30/10/24	0.00	45,270,000.00	101.379000	24/12/19	2.347709	45,894,273.30		107.749151	48,778,040.76	8.02	6.43	6.53
GRUP TOPLAMI					406,440,000.00				173,430,353.25			461,058,886.62	75.77	60.80	61.72
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDBRKT12031	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	22/01/20	0.00	11,020,000.00	100.110900	04/11/19	20.004082	11,032,221.18		102.501364	11,295,650.26	1.86	1.49	1.51
TRDHVKA12014	TL	HALK VARLIK KIRALAMA A.Ş.	28/01/20	8.87	1,000,000.00	100.000000	06/08/19	18.97583	1,000,000.00		107.530653	1,075,306.53	0.18	0.14	0.14
TRDTFVK22017	TL	TF VARLIK KIRALAMA	17/02/20	0.00	14,200,000.00	101.449300	31/12/19	11.911793	14,405,800.60		101.511580	14,414,644.32	2.37	1.90	1.93
TRDBRKT22030	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	28/02/20	0.00	1,500,000.00	100.598100	10/12/19	10.154495	1,508,971.50		101.370557	1,520,558.35	0.25	0.20	0.20
		ZIRAAT KATILIM													
TRDZKVK42012	TL	VARLIK KIRALAMA A.Ş.	03/04/20	2.66	9,500,000.00	100.000000	27/12/19	10.263929	9,500,000.00		100.160753	9,515,271.50	1.56	1.25	1.27
TRDKTLM42012	TL	ZORLU ENERJİ A.Ş.	17/04/20	0.00	46,000,000.00	100.193400	27/04/18	14.582844	46,088,964.00		106.044490	48,780,465.20	8.02	6.43	6.53
TRDKTLM52011	TL	QNB FİNANS LEASING	27/05/20	0.00	45,050,000.00	100.335500	17/08/18	14.544263	45,201,142.75		101.191276	45,586,669.74	7.49	6.01	6.10
		DERİNDERE TURİZM													
TRDKTSK61912	TL	OTOMOTİV SAN. VE TİC. A.Ş.	19/06/20	0.00	8,975,000.00	102.296000	20/06/19	29.408207	9,181,066.00		101.063778	9,070,474.07	1.49	1.20	1.21
TRDYVKA2119	TL	PALMET GAZ	24/12/21	16.56	6,100,000.00	100.000000	27/12/19	17.674991	6,100,000.00		100.267819	6,116,336.98	1.01	0.81	0.82
GRUP TOPLAMI					143,345,000.00				144,018,166.03			147,375,376.95	24.23	19.43	19.71
GRUP TOPLAMI					549,785,000.00				317,448,519.28			608,434,263.57	100.00	80.23	81.43
FON PORTFÖY DEĞERİ												758,585,140.02		100.00	

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2019			31 Aralık 2018		
	Tutar	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%	TL	%	%
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	758,585,140		101.54	556.907.486		100,15
B. HAZIR DEĞERLER	87,209		0.01	26,018		-
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	87,209	100.00	0.01	26,018	100,00	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	48,472		0.01	21,123		-
a)Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-	-	-	-
i) T1 Alacaklar	-	-	-	-	-	-
ii) T2 Alacaklar	-	-	-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	48,472		0.01	21,123		-
D. DİĞER VARLIKLAR				-	-	-
E. BORÇLAR	(11,610,214)		(1.55)	(877,828)		(0,16)
a) Takasa Borçlar	(10,408,940)	89.65	(1.39)			
i) T1 Borçları	(5,399,750)					
ii) T2 Borçları	(5,009,190)					
iii) İhbarlı Fon Pay Takas	-					
b) Yönetim Ücreti	(1,164,938)	10.03	(0.16)	(848,286)	96,63	(0,15)
c) DİĞER_BORÇLAR	(13,923)	0.31	-	(1,286)	3,37	-
i) Diğer	(1,093)		-	-		-
ii) Denetim Ücreti	(12,831)		-	(12,860)		-
d) Kayda Alma Ücreti	(22,413)	0.19	-	(16,682)	1,90	-
FON TOPLAM DEĞERİ	747,110,607			556.076.800		
Toplam Pay Sayısı	1,000,000,000,000			1.000.000.000.000		
Dolaşımdaki Pay	40,679,375,615			37.222.105.705		
BİRİM PAY DEĞERİ	0.018366			0,014939		