

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM HİSSE SENEDİ 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 HİSSE SENEDİ 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 Hisse Senedi 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 Hisse Senedi 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 HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul					Birim	Satın	İç	Repo	Net	Günlük				
Kıymet	Döviz Cinsi	İhraççı	Vade	Kar Payı	Nominal	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Dönüş	Birim	Toplam	Grup	Toplan
		Kurum	Tarihi	Oran	Değer	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Tutar	Deger	Deger	(%)	(FPD göre)
HİSSE SENETLERİ														
Hisse Türk														
ALBRK	TL	ALBARAKA TURK KATILIM BANKASI A.Ş.			4,000,000.00	1.149515	31/12/19		4,598,060.00		1.530000	6,120,000.00	4.61	4.13
ALKIM	TL	ALKIM			200,000.00	21.983811	01/10/19		4,396,762.20		38.320000	7,664,000.00	5.78	5.17
ASELS	TL	ASELS			250,000.00	21.342429	03/10/19		5,335,607.25		20.940000	5,235,000.00	3.95	3.53
BIMAS	TL	BIMAS			200,000.00	45.798397	18/12/19		9,159,679.40		46.660000	9,332,000.00	7.03	6.30
CEMTS	TL	CEMTS			300,000.00	5.159117	16/10/19		1,547,735.10		8.280000	2,484,000.00	1.87	1.68
CUSAN	TL	CUHADAROĞLU METAL SANAYİ A.Ş			963,339.00	2.341156	16/12/19		2,255,326.88		3.190000	3,073,051.41	2.32	2.07
EGEEN	TL	EGEEN			3,100.00	500.855716	19/12/19		1,552,652.72		580.500000	1,799,550.00	1.36	1.22
EGSER	TL	EGSER			1,850,000.00	3.466796	28/11/19		6,413,572.60		3.710000	6,863,500.00	5.17	4.63
ENKAI	TL	ENKAI			0.22	4.909091	28/05/18		1.08		6.420000	1.41	0.00	0.00
ERBOS	TL	ERBOS			167,500.78	16.385361	10/10/19		2,744,560.75		24.980000	4,184,169.48	3.15	2.82
EREGL	TL	EREGL			1,600,000.00	7.419030	06/12/19		11,870,448.00		9.040000	14,464,000.00	10.91	9.78
FROTO	TL	FROTO			137,500.00	61.800452	19/12/19		8,497,562.15		70.850000	9,741,875.00	7.34	6.58
GEDZA	TL	GEDİZ AMBALAJ SANAYİ TIC.A.Ş			350,000.00	3.821177	10/12/19		1,337,411.95		6.760000	2,366,000.00	1.78	1.60
GENTS	TL	GENTS			825,000.00	1.345420	14/10/19		1,109,971.50		2.190000	1,806,750.00	1.36	1.22
GOODY	TL	GOODY			1,230,000.00	3.717604	29/03/19		4,572,652.92		4.050000	4,981,500.00	3.76	3.36
ISDMR	TL	ISDMR			500,000.00	6.495205	06/12/19		3,247,602.50		8.010000	4,005,000.00	3.02	2.70
JANTS	TL	JANTS			117,667.00	28.149587	18/10/19		3,312,277.45		58.300000	6,859,986.10	5.17	4.63
KARTN	TL	KARTN			7,500.00	311.444680	26/08/19		2,335,835.10		389.900000	2,924,250.00	2.20	1.97
KONYA	TL	KONYA			6,000.00	187.237050	27/11/19		1,123,422.30		271.300000	1,627,800.00	1.23	1.10
KRONT	TL	KRONT			511,000.00	11.013052	25/11/19		5,627,669.57		12.720000	6,499,920.00	4.90	4.39
KUTPO	TL	KUTPO			830,000.00	5.611500	31/10/18		4,657,545.00		6.620000	5,494,600.00	4.14	3.71
LOGO	TL	LOGO			32,000.00	40.829847	31/12/19		1,306,555.10		60.800000	1,945,600.00	1.47	1.31
LOGO	TL	LOGO			(2,000.00)	40.829846	31/12/19		(81,659.69)		60.800000	(121,600.00)	(0.09)	(0.08)
MAVI	TL	MAVİ GIYIM			157,500.00	37.955127	30/12/19		5,977,932.50		57.900000	9,119,250.00	6.87	6.16
PETUN	TL	PETUN			607,500.00	7.453103	04/12/19		4,527,760.07		9.170000	5,570,775.00	4.20	3.76
SELEC	TL	SELEC			80,000.00	5.147125	25/11/19		411,770.00		6.100000	488,000.00	0.37	0.33
SODA	TL	SODA			0.09	4.333333	11/07/18		0.39		6.180000	0.56	0.00	0.00
TATGD	TL	TATGD			657,398.00	4.437983	25/12/19		2,917,521.15		6.290000	4,135,033.42	3.12	2.79
ULUSE	TL	ULUSOY ELEKTRİK			150,000.00	15.231168	24/10/19		2,284,675.20		26.600000	3,990,000.00	3.01	2.69
GRUP TOPLAMI					15,731,005.09				103,040,911.15		132,654,012.38	100.00	89.55	88.42
GRUP TOPLAMI					15,731,005.09				103,040,911.15		132,654,012.38	100.00	89.55	88.42

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. KATILIM HİSSE SENEDİ 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 Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Deger	Toplam Deger	Grup (%)	Toplan (FPD göre)	Toplam (FTD göre)
KATILIM HESABI															
ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		06/01/20	11.60	1,000,000.00		03/12/19			1,010,805.48	11.600000	1,009,534.25	40.05	0.68	0.67
ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		10/01/20	11.00	1,500,000.00		09/12/19			1,514,465.75	11.000000	1,510,849.32	59.95	1.02	1.01
GRUP TOPLAMI					2,500,000.00							2,520,383.57	100.00	1.70	1.68
GRUP TOPLAMI					2,500,000.00							2,520,383.57	100.00	1.70	1.68
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
TRD230920T24	TL	HAZİNE	23/09/20	0.00	1,749,806.00	111.047300	23/08/19	10.176468	1,943,112.32		116.510845	2,038,713.75	15.73	1.38	1.36
TRD181120T19	TL	HAZİNE	18/11/20	0.00	500,000.00	107.057200	10/10/19	10.538588	535,286.00		108.375485	541,877.42	4.18	0.37	0.36
TRD100221T17	TL	HAZİNE	10/02/21	0.00	340,000.00	102.002200	17/10/19	10.971968	346,807.48		113.885953	387,212.24	2.99	0.26	0.26
TRD140721T18	TL	HAZİNE	14/07/21	0.00	200,000.00	104.569200	12/10/16	9.878910	209,138.40		104.050708	208,101.42	1.61	0.14	0.14
GRUP TOPLAMI					2,789,806.00				3,034,344.20			3,175,904.83	24.51	2.15	2.12
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDZKVK22014	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	21/02/20	3.15	500,000.00	100.000000	15/11/19	10.163851	500,000.00		101.795978	508,979.89	3.93	0.34	0.34
TRDBRKT22014	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	28/02/20	5.58	1,000,000.00	100.000000	04/10/19	9.769836	1,000,000.00		104.052139	1,040,521.39	8.03	0.70	0.69
TRDBRKT22030	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	28/02/20	2.91	500,000.00	100.000000	22/11/19	10.154495	500,000.00		101.370557	506,852.78	3.91	0.34	0.34
TRDZKVK32013	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	11/03/20	2.96	200,000.00	100.000000	12/12/19	9.974182	200,000.00		101.124933	202,249.87	1.56	0.14	0.13
TRDBRKT32021	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	25/03/20	2.66	3,500,000.00	100.000000	20/12/19	10.276203	3,500,000.00		100.398167	3,513,935.85	27.08	2.37	2.34
TRDZKVK42012	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	03/04/20	2.66	3,000,000.00	100.000000	27/12/19	10.263929	3,000,000.00		100.160753	3,004,822.58	23.18	2.03	2.00
TRDBRKT52011	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	29/05/20	5.72	1,000,000.00	100.000000	28/11/19	11.723952	1,000,000.00		101.068716	1,010,687.16	7.80	0.68	0.67
GRUP TOPLAMI					9,700,000.00				9,700,000.00			9,788,049.52	75.49	6.60	6.51
GRUP TOPLAMI					12,489,806.00				12,734,344.20			12,963,954.35	100.00	8.75	8.63
FON PORTFÖY DEĞERİ											148,138,350.30			100.00	

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. KATILIM HİSSE SENEDİ 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	148,138,350		98.71	85.715.804		99,47
B. HAZIR DEĞERLER	2,224,254		1.48	340,861		0,40
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	2,224,254	100.00	1.48	340,861	100,00	0,40
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	148,398		0.10	556,408		0,65
a)Takastan Alacaklar Toplamı	119,750	100.00	0.08	529,650	100,00	0,61
i) T1 alacakları	58,950		-	26,758		0,03
ii) T2 alacakları	60,800		-	-		-
b) Diğer Alacaklar	28,648		0.02	26,758		0,03
D. DİĞER VARLIKLAR						
E. BORÇLAR	(429,880)		(0.29)	(440,610)		(0,51)
a) Takasa Borçlar	-	-	-	(173,000)	39,26	(0,20)
i) İhbarlı Fon Pay Takas	-		-	-		-
a) T1 Borçları	-		-	(173,000)	39,26	(0,20)
b) T2 Borçları	-		-	-		-
c) İhbarlı Fon Pay Takas	(151,876)		-	(102,576)		-
d) Yönetim Ücreti	(271,595)	63.18	(0.18)	(159,958)	36,30	(0,19)
e) DİĞER BORÇLAR	(1,906)	1.49	-	(2,491)	1,15	-
i) Diğer	(6)		-	(68)		-
ii) Denetim Reeskontu	(1,900)		-	(2,424)		-
f) Kayda Alma Ücreti	(4,502)	1.05	-	(2,585)	0,59	-
FON TOPLAM DEĞERİ	150,081,123			86.172.463		
Toplam Pay Sayısı	1,000,000,000,000			1.000.000.000.000		
Dolaşımdaki Pay	6,972,675,133			6.394.448.157		
BİRİM PAY DEĞERİ	0.021524			0,013476		