

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS ATAK KATILIM DEĞİŞKEN 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.
OKS ATAK KATILIM DEĞİŞKEN 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. OKS Atak Katılım Değişken 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. OKS Atak Katılım Değişken 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. OKS ATAK KATILIM DEĞİŞKEN 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	Ahş	Ahş	İskonto	Teminat	Dönüş	Birim	Toplam	Grup	Toplan	Toplam	
						Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Tutar	Deger	Deger	(%)	(FPD göre)	(FTD göre)	
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
ALKIM	TL	ALKIM			2,000.00	27.490275	18/12/19		54,980.55		38.320000	76,640.00	10.59	3.34	3.31	
ASELS	TL	ASELS			2,000.00	19.255625	25/09/19		38,511.25		20.940000	41,880.00	5.78	1.83	1.81	
BIMAS	TL	BIMAS			1,500.00	46.551113	18/12/19		69,826.67		46.660000	69,990.00	9.66	3.05	3.02	
CEMTS	TL	CEMTS			5,000.00	5.150000	05/09/19		25,750.00		8.280000	41,400.00	5.71	1.80	1.79	
		CUHADAROĞLU														
CUSAN	TL	METAL SANAYİ A.Ş			10,000.00	3.100000	18/12/19		31,000.00		3.190000	31,900.00	4.40	1.39	1.38	
EGSER	TL	EGSER			15,000.00	3.010266	16/10/19		45,153.99		3.710000	55,650.00	7.68	2.42	2.40	
ERBOS	TL	ERBOS			0.43	16.395349	09/10/19		7.05		24.980000	10.74	0.00	0.00	0.00	
EREGL	TL	EREGL			7,000.00	7.082449	25/09/19		49,577.14		9.040000	63,280.00	8.73	2.76	2.73	
PROTO	TL	PROTO			350.00	60.560000	30/12/19		21,196.00		70.850000	24,797.50	3.42	1.08	1.07	
GENTS	TL	GENTS			7,500.00	1.326667	18/10/19		9,950.00		2.190000	16,425.00	2.27	0.72	0.71	
GOODY	TL	GOODY			5,000.00	3.495000	29/03/19		17,475.00		4.050000	20,250.00	2.79	0.88	0.88	
ISDMR	TL	ISDMR			5,000.00	6.474000	21/11/19		32,370.00		8.010000	40,050.00	5.53	1.75	1.73	
JANTS	TL	JANTS			300.00	27.876667	10/12/19		8,363.00		58.300000	17,490.00	2.41	0.76	0.76	
KARTN	TL	KARTN			100.00	311.225000	16/10/19		31,122.50		389.900000	38,990.00	5.38	1.70	1.68	
KRONT	TL	KRONT			5,000.00	8.770448	15/10/19		43,852.24		12.720000	63,600.00	8.78	2.77	2.75	
MAVI	TL	MAVI GIYIM			400.00	40.838525	30/12/19		16,335.41		57.900000	23,160.00	3.20	1.01	1.00	
PETUN	TL	PETUN			5,000.00	8.800000	18/12/19		44,000.00		9.170000	45,850.00	6.33	2.00	1.98	
ULUSE	TL	ULUSOY ELEKTRİK			2,000.00	22.047855	18/12/19		44,095.71		26.600000	53,200.00	7.34	2.32	2.30	
GRUP TOPLAMI					73,150.43				583,566.52			724,563.24	100.00	31.58	31.30	
GRUP TOPLAMI					73,150.43				583,566.52			724,563.24	100.00	31.58	31.30	
KİRA SERTİFİKALARI																
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları																
TRD230920T24	TL	HAZİNE	23/09/20	0.00	125,984.00	110.305100	15/10/19	10.176468	138,966.78		116.510845	146,785.02	9.35	6.40	6.34	
TRD181120T19	TL	HAZİNE	18/11/20	0.00	70,000.00	110.408700	18/10/19	10.538588	77,286.09		108.375485	75,862.84	4.83	3.31	3.28	
TRD100221T17	TL	HAZİNE	10/02/21	0.00	260,000.00	100.717500	28/11/19	10.971968	261,865.50		113.885953	296,103.48	18.88	12.89	12.80	
TRD140721T18	TL	HAZİNE	14/07/21	0.00	70,000.00	103.270300	10/12/19	9.878910	72,289.21		104.050708	72,835.50	4.64	3.17	3.15	
TRD301024T10	TL	HAZİNE	30/10/24	0.00	50,000.00	107.654400	31/12/19	2.347709	53,827.20		107.749151	53,874.58	3.43	2.35	2.33	
GRUP TOPLAMI					575,984.00				604,234.78			645,461.42	41.13	28.12	27.90	

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS ATAK KATILIM DEĞİŞKEN 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 Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplan (FPD göre)	Toplam (FTD göre)
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDHVKA12014	TL	HALK VARLIK KİRALAMA A.Ş.	28/01/20	8.87	20,000.00	100.000000	06/08/19	18.975830	20,000.00		107.530653	21,506.13	1.37	0.94	0.93
TRDZKVK12031	TL	ZİRAAT FİNANSAL KİRALAMA	29/01/20	3.39	20,000.00	100.000000	25/10/19	13.370914	20,000.00		102.437508	20,487.50	1.30	0.89	0.89
TRDBRKT22022	TL	BEREKET VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12/02/20	0.00	70,000.00	100.475700	06/12/19	10.042057	70,332.99		101.949235	71,364.46	4.54	3.11	3.08
TRDKTLM22014	TL	QNB FİNANS LEASING	12/02/20	0.00	10,000.00	103.013400	13/09/18	14.271278	10,301.34		101.858434	10,185.84	0.65	0.44	0.44
TRDVVRK22018	TL	VAKIF VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12/02/20	3.09	50,000.00	100.000000	06/11/19	9.896317	50,000.00		102.000726	51,000.36	3.25	2.22	2.20
TRDBRKT22014	TL	BEREKET VARLIK KİRALAMA A.Ş.	28/02/20	5.58	50,000.00	100.000000	04/10/19	9.769836	50,000.00		104.052139	52,026.07	3.31	2.27	2.25
TRDBRKT22030	TL	BEREKET VARLIK KİRALAMA A.Ş.	28/02/20	0.00	110,000.00	100.183800	03/12/19	10.154495	110,202.18		101.370557	111,507.61	7.10	4.86	4.82
TRDHVKA32020	TL	EMLAK GMYO	03/03/20	5.08	100,000.00	100.000000	22/10/19	8.193298	100,000.00		103.709180	103,709.18	6.60	4.52	4.48
TRDZKVK32013	TL	VARLIK KİRALAMA A.Ş.	11/03/20	2.96	70,000.00	100.000000	06/12/19	9.974182	70,000.00		101.124933	70,787.45	4.51	3.09	3.06
TRDBRKT32021	TL	BEREKET VARLIK KİRALAMA A.Ş.	25/03/20	2.66	260,000.00	100.000000	20/12/19	10.276203	260,000.00		100.398167	261,035.23	16.62	11.37	11.28
TRDHVKA42011	TL	HALK VARLIK KİRALAMA A.Ş.	07/04/20	4.64	50,000.00	100.000000	19/11/19	12.529945	50,000.00		101.441968	50,720.98	3.23	2.21	2.19
TRDKTLM52011	TL	QNB FİNANS LEASING	27/05/20	0.00	20,000.00	102.649900	20/07/18	14.544263	20,529.98		101.191276	20,238.26	1.29	0.88	0.87
TRDHVKA62019	TL	EMLAK GMYO	09/06/20	4.92	40,000.00	100.000000	24/12/19	11.009755	40,000.00		100.257877	40,103.15	2.55	1.75	1.73
TRDYVKA2119	TL	PALMET GAZ	24/12/21	16.56	40,000.00	100.000000	27/12/19	17.674991	40,000.00		100.267819	40,107.13	2.55	1.75	1.73
GRUP TOPLAMI					910,000.00				911,366.49			924,779.35	58.87	40.30	39.95
GRUP TOPLAMI					1,485,984.00				1,515,601.27			1,570,240.77	100.00	68.42	67.85
FON PORTFÖY DEĞERİ												2,294,804.01		100.00	

**KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS ATAK KATILIM DEĞİŞKEN
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	2,294,804		99.17	741,373		99.46
B. HAZIR DEĞERLER	32,556		1.41	2,868		0.38
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	32,556	100.00	1.41	2,868	100.00	0.38
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	2,140		0.09	3,597		0.48
a)Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-	-	-	-
i) T1 Alacakları	-		-	-	-	-
ii) T2 Alacakları	-		-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	2,140		0.09	3,597		0.48
D. DİĞER VARLIKLAR						
E. BORÇLAR	(15,424)		(0.67)	(2,425)		0.33
a) Takasa Borçlar	-	-	-	-	-	-
i) İhbarlı Fon Pay Takas	(293)		-	-	-	-
b) Yönetim Ücreti	(1,618)	10.49	(0.07)	(505)	20.80	(0.07)
c) DİĞER_BORÇLAR	(13,444)	87.61	(0.58)	(1,456)	60.95	(0.20)
i) Diğer	(12,304)		(0.53)	(561)		(0.08)
ii) Denetim Reeskontu	(1,140)		(0.05)	(895)		(0.12)
d) Kayda alma ücreti	(69)	0.45	-	(22)	0.92	-
FON TOPLAM DEĞERİ	2,314,077			745,413		
Toplam Pay Sayısı	1,000,000,000,000			1,000,000,000,000		
Dolaşımdaki Pay	147,372,456			65,341,136		
BİRİM PAY DEĞERİ	0.015702			0.011408		