

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI 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



**VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI
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**

Vakıf Emeklilik ve Hayat A.Ş. Para Piyasası 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 ilişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Vakıf Emeklilik ve Hayat A.Ş. Para Piyasası 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 ilişkin 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 Vakıf Emeklilik ve Hayat A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

Dikkat Çekilen Husus

Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 8 Kasım 2019 tarih ve E.14112 sayılı izin çerçevesinde Vakıf Emeklilik ve Hayat A.Ş. Para Piyasası Grup Emeklilik Yatırım Fonu, Vakıf Emeklilik ve Hayat A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu'nun bünyesinde 23 Aralık 2019 tarihi itibarıyla birleşmiştir.

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


Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 17 Nisan 2020

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-3
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	4

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kaynak	İhracatçı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tamm	Nominal Faiz Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oran	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
BORÇLANMA SENETLERİ															
BONO															
TRB220120T17	HAZINE	22/01/20		0,00		19.000.000	97,537	23/12/19	10,648		99,420		18.889.716	2,93	1,69
GRUP TOPLAMI						19.000.000							18.889.716	2,93	1,69
DEVLET TAHVİLİ															
TRT150120T16	HAZINE	15/01/20		0,00		41.000.000	99,901	31/12/19	10,425		104,845		42.986.398	6,66	3,85
TRT050220T17	HAZINE	05/02/20		0,00		101.500.000	100,513	23/12/19	10,541		102,708		104.248.824	16,17	9,38
TRT110320T18	HAZINE	11/03/20		0,00		22.000.000	106,665	23/12/19	11,366		108,252		23.815.425	3,69	2,13
TRT130520T14	HAZINE	13/05/20		0,00		63.000.000	95,189	23/12/19	10,665		96,375		60.716.095	9,41	5,44
TRT100620T16	HAZINE	10/06/20		0,00		55.000.000	95,207	31/12/19	10,997		95,502		52.526.262	8,14	4,70
						282.500.000							284.293.004	44,07	25,50
ÖZEL SEKTÖR															
FİNANSMAN BONOSU															
TRFAKBK12023	AKBANK T.A.Ş.	03/01/20		0,00		15.000.000	97,613	23/12/19	12,180		99,937044		14.990.557	2,32	1,34
TRFFNBK12018	QNB FİNANSBANK A.Ş.	03/01/20		0,00		16.000.000	97,556	23/12/19	14,772		99,924535		15.987.926	2,48	1,43
TRFDNFK12014	DENİZ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	10/01/20		0,00		7.000.000	100,121	23/12/19	0,000		100,655024		7.045.852	1,09	0,63
TRFDNFK12022	DENİZ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	10/01/20		0,00		16.000.000	97,264	23/12/19	14,980		99,656406		15.945.025	2,47	1,43
TRFOYMD12019	OYAK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	10/01/20		13,10		1.020.000	97,549	01/11/19	11,143		99,739835		1.017.346	0,16	0,09
TRFODEA12024	ODEABANK A.Ş.	10/01/20		0,00		9.000.000	97,314	23/12/19	15,009		99,655783		8.969.020	1,39	0,80
TRFISFN12016	İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	13/01/20		13,90		4.990.000	96,544	11/10/19	14,633		99,552011		4.967.645	0,77	0,45
TRFHILFK12019	HALK FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	15/01/20		0,00		6.000.000	97,347	23/12/19	14,934		99,467542		5.968.053	0,93	0,53
TRFNURL12029	NUROL YATIRIM BANKASI A.Ş.	16/01/20		0,00		3.000.000	97,228	23/12/19	14,309		99,451912		2.983.557	0,46	0,27
TRFDZBK12033	DENİZBANK A.Ş.	17/01/20		0,00		7.000.000	97,573	23/12/19	13,299		99,454179		6.961.793	1,08	0,62
TRFYKYM12013	YAPI KREDİ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	22/01/20		0,00		4.000.000	97,318	23/12/19	12,498		99,324714		3.972.989	0,62	0,36
TRFALNF22017	ALTERNATİFBANK A.Ş.	04/02/20		12,50		1.850.000	97,010	06/11/19	13,101		98,859764		1.828.906	0,28	0,16
TRFNURL22010	NUROL YATIRIM BANKASI A.Ş.	05/02/20		0,00		4.000.000	97,185	23/12/19	15,285		98,645329		3.945.813	0,61	0,35
TRFPASH22013	PASHA YATIRIM BANKASI A.Ş.	05/02/20		0,00		2.500.000	98,186	23/12/19	11,953		98,923136		2.473.078	0,38	0,22
TRFHILFK22018	HALK FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	12/02/20		13,20		15.000.000	96,375	31/10/19	13,837		98,519823		14.777.973	2,29	1,32
TRFTHAL22010	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	26/02/20		0,00		27.000.000	99,982	23/12/19	0,000		100,252436		27.068.158	4,20	2,42
TRFVKFB32019	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O	03/03/20		0,00		10.070.000	100,138	23/12/19	0,000		100,685126		10.138.992	1,57	0,91
TRFTISB32010	T.İ.S BANKASI A.Ş.	05/03/20		0,00		13.000.000	100,067	23/12/19	0,000		100,554029		13.072.024	2,03	1,17
TRFTCZB32018	T.C. ZİRAAT BANKASI A.Ş.	06/03/20		0,00		14.230.000	100,209	23/12/19	0,000		101,437640		14.434.576	2,24	1,29
TRFFINF32011	QNB FİNANS FAKTORİNG A.Ş.	10/03/20		10,55		4.000.000	97,823	24/12/19	10,997		98,046958		3.921.878	0,61	0,35
TRFNURL32019	NUROL YATIRIM BANKASI A.Ş.	11/03/20		11,00		4.300.000	97,732	25/12/19	11,488		97,936039		4.211.250	0,65	0,38
TRFYKKB32021	YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.	13/03/20		0,00		8.600.000	100,343	23/12/19	0,000		101,117671		8.696.120	1,35	0,78
TRFGRAN32011	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	17/03/20		0,00		23.000.000	100,135	23/12/19	0,000		100,877638		23.201.857	3,60	2,08
TRFGRAN42010	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	20/04/20		0,00		12.700.000	100,020	23/12/19	0,000		100,367898		12.746.723	1,98	1,14

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
TRFTHAL52017	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	06/05/20		0,00		55.000.000	100,463	23/12/19	0,000		101,968		56.082.594	8,69	5,02
TRFTHAL52025	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	15/05/20		0,00		7.000.000	100,194	23/12/19	0,000		101,630		7.114.085	1,10	0,64
TRFTHAL62016	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	19/06/20		7,72		16.000.000	100,000	20/12/19	0,000		100,359		16.057.401	2,49	1,44
TRFYKBK62028	YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.	22/06/20		3,97		22.000.000	100,000	31/12/19	0,000		100,031		22.006.758	3,41	1,97
TRFFNBK62013	QNB FINANSBANK A.S.	26/06/20		13,74		11.300.000	100,000	27/12/19	0,000		100,151		11.317.105	1,75	1,01
GRUP TOPLAMI						340.560.000							341.905.052	53,00	30,60
GRUP TOPLAMI						340.560.000							341.905.052	53,00	30,60
GRUP TOPLAMI						642.060.000							645.087.771	100,00	57,79
T.REPO															
TRT020322T17	HAZINE	02/01/20		11,37		20.012.460	11,370	31/12/19		20048550	11,380		20.006.224	4,26	1,79
TRT020322T17	HAZINE	02/01/20		11,36		20.012.449	11,360	31/12/19		20048540	11,380		20.006.213	4,25	1,79
TRT030523T13	HAZINE	02/01/20		11,36		15.509.648	11,360	31/12/19		8502825	11,380		15.504.815	3,29	1,39
TRT030523T13	HAZINE	02/01/20		11,36		4.502.801	11,360	31/12/19		2468565	11,380		4.501.398	0,96	0,40
TRT041126T11	HAZINE	02/01/20		11,30		2.501.548	11,300	31/12/19		2557535	11,380		2.500.768	0,53	0,22
TRT050220T17	HAZINE	02/01/20		11,37		1.000.623	11,370	31/12/19		1004450	11,380		1.000.311	0,21	0,09
TRT050624T19	HAZINE	02/01/20		11,35		9.005.597	11,350	31/12/19		9001010	11,380		9.002.791	1,91	0,81
TRT050624T19	HAZINE	02/01/20		11,36		9.005.602	11,360	31/12/19		9001015	11,380		9.002.796	1,91	0,81
TRT050624T35	HAZINE	02/01/20		11,35		1.500.933	11,350	31/12/19		1358495	11,380		1.500.465	0,32	0,13
TRT050624T35	HAZINE	02/01/20		11,35		1.500.933	11,350	31/12/19		1358495	11,380		1.500.465	0,32	0,13
TRT060121T16	HAZINE	02/01/20		11,37		8.505.296	11,370	31/12/19		3612390	11,380		8.502.645	1,80	0,76
TRT060121T16	HAZINE	02/01/20		11,30		8.505.263	11,300	31/12/19		3612375	11,380		8.502.612	1,80	0,76
TRT060825T15	HAZINE	02/01/20		11,35		19.011.816	11,350	31/12/19		18243580	11,380		19.005.892	4,03	1,70
TRT070727T13	HAZINE	02/01/20		11,35		1.000.622	11,350	31/12/19		765455	11,380		1.000.310	0,21	0,09
TRT070727T13	HAZINE	02/01/20		11,37		10.006.230	11,370	31/12/19		7654535	11,380		10.003.112	2,12	0,90
TRT070727T13	HAZINE	02/01/20		11,37		2.501.558	11,370	31/12/19		1913640	11,380		2.500.778	0,53	0,22
TRT070727T13	HAZINE	02/01/20		11,37		12.507.788	11,370	31/12/19		9568170	11,380		12.503.890	2,65	1,12
TRT070727T13	HAZINE	02/01/20		11,37		1.000.623	11,370	31/12/19		765460	11,380		1.000.311	0,21	0,09
TRT070727T13	HAZINE	02/01/20		11,30		11.507.121	11,300	31/12/19		8802675	11,380		11.503.535	2,44	1,03
TRT070727T13	HAZINE	02/01/20		11,37		11.507.165	11,370	31/12/19		8802710	11,380		11.503.579	2,44	1,03
TRT080323T10	HAZINE	02/01/20		11,30		17.510.836	11,300	31/12/19		19921315	11,380		17.505.379	3,72	1,57
TRT080323T10	HAZINE	02/01/20		11,37		17.510.903	11,370	31/12/19		19921395	11,380		17.505.446	3,72	1,57
TRT110226T13	HAZINE	02/01/20		11,35		18.511.505	11,350	31/12/19		19373635	11,380		18.505.737	3,93	1,66
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20		11,35		18.511.505	11,350	31/12/19		19723100	11,380		18.505.737	3,93	1,66
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20		11,37		16.510.280	11,370	31/12/19		17590890	11,380		16.505.135	3,50	1,48
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20		11,37		6.003.738	11,370	31/12/19		6396690	11,380		6.001.867	1,27	0,54
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20		11,35		3.001.866	11,350	31/12/19		3198345	11,380		3.000.930	0,64	0,27
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20		11,36		6.003.735	11,360	31/12/19		6396685	11,380		6.001.864	1,27	0,54

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanım	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20		11,35		13.008.085	11,350	31/12/19		13.859.480	11,380		13.004.031	2,76	1,16
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20		11,35		7.004.353	11,350	31/12/19		7.462.800	11,380		7.002.171	1,49	0,63
TRT120820T12	HAZINE	02/01/20		11,37		3.502.181	11,370	31/12/19		3.112.750	11,380		3.501.089	0,74	0,31
TRT140126T11	HAZINE	02/01/20		11,35		11.006.841	11,350	31/12/19		7.318.915	11,380		11.003.411	2,34	0,99
TRT140623T19	HAZINE	02/01/20		11,37		15.009.345	11,370	31/12/19		13.617.380	11,380		15.004.668	3,18	1,34
TRT160425T17	HAZINE	02/01/20		11,37		7.504.673	11,370	31/12/19		4.729.350	11,380		7.502.334	1,59	0,67
TRT180123T10	HAZINE	02/01/20		11,37		19.011.837	11,370	31/12/19		18.288.880	11,380		19.005.913	4,03	1,70
TRT180123T10	HAZINE	02/01/20		11,35		17.010.573	11,350	31/12/19		16.363.720	11,380		17.005.272	3,61	1,52
TRT180123T10	HAZINE	02/01/20		11,35		3.001.866	11,350	31/12/19		2.887.720	11,380		3.000.930	0,64	0,27
TRT180123T10	HAZINE	02/01/20		11,35		17.010.573	11,350	31/12/19		16.363.720	11,380		17.005.272	3,61	1,52
TRT210421T14	HAZINE	02/01/20		11,37		5.003.115	11,370	31/12/19		4.461.135	11,380		5.001.556	1,06	0,45
TRT210721T11	HAZINE	02/01/20		11,35		9.505.908	11,350	31/12/19		4.230.735	11,380		9.502.946	2,02	0,85
TRT230222T13	HAZINE	02/01/20		11,36		14.008.715	11,360	31/12/19		6.570.325	11,380		14.004.349	2,97	1,25
TRT230222T13	HAZINE	02/01/20		11,37		14.008.722	11,370	31/12/19		6.570.330	11,380		14.004.357	2,97	1,25
TRT261022T10	HAZINE	02/01/20		11,36		13.008.092	11,360	31/12/19		6.483.950	11,380		13.004.038	2,76	1,17
TRT261022T10	HAZINE	02/01/20		11,35		10.506.530	11,350	31/12/19		5.237.035	11,380		10.503.256	2,23	0,94
TRT261022T10	HAZINE	02/01/20		11,36		11.006.847	11,360	31/12/19		5.486.420	11,380		11.003.417	2,34	0,98
TRT280628T18	HAZINE	02/01/20		11,36		7.004.357	11,360	31/12/19		5.996.320	11,380		7.002.174	1,49	0,63
GRUP TOPLAMI						471.293.056							471.146.184	100,00	42,18
GRUP TOPLAMI						471.293.056							471.146.184	100,00	42,18
TPP															
TPP		02/01/20		10,80		307.181,68	10,800000	31/12/19			10,780		307.091,00	100,00	0,03
						307.181,68							307.091	100,00	0,03
						307.181,68							307.091	100,00	0,03
FON PORTFÖY DEĞERİ													1.116.541.047		100,00

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI 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 TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	1.116.541.047		100,05	758.419.762	-	100,08
B,HAZİR DEĞERLER	1.397	-	-	625	100	0,00
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	1.397	100,00	-	625	100,00	0,00
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	-	-	-	-	-	-
C,ALACAKLAR	294.184		0,03	194	-	0,00
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	294.184	-	0,03	194	-	0,00
D,DIĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	-859.965	-	-0,08	-595.204	-	-0,08
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-	-	-	-
d) Yönetim Ücreti	-701.376	81,56	-0,06	-538.200	90,42	-0,07
e) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
f) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
g) Krediler	-	-	-	-	-	-
h) Diğer Borçlar	-125.101	18,44	-0,01	-34.255	9,58	0,00
i) Denetim Ücreti	-9.918	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	-	-	-	-4.723	-	0
vii) Diğer	-115.183	-	-0,01	-29.531	-	0,00
i) İhbarlı FonPay Takas	-	-	-	-	-	-
j) Kayda Alma Ücreti	-33.488	3,89	-	-22.749	3,82	0,00
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	1.115.976.663		100,00	757.825.378		100,00