

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM KATKI 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.
KATILIM KATKI
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. Katılım Katkı 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. Katılım Katkı 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.

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.
KATILIM KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-2
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	3

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM KATKI 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 Tatımı	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 (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
ALCTL	ALCATEL LUCENT TELETAS TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	-	-	-	140.000,00	10,720145	30/12/19	-	-	12,040000	-	1.685.600,00	4,31	0,62
ALKIM	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.	-	-	-	-	61.987,00	26,404947	31/12/19	-	-	38,320000	-	2.375.341,84	6,08	0,87
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SAN. ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	128.000,00	19,320264	31/12/19	-	-	20,940000	-	2.680.320,00	6,85	0,99
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SAN. ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	-6.000,00	19,320264	31/12/19	-	-	20,940000	-	-125.640,00	-0,32	-0,05
BANVT	BANVİT BANDIRMANLI VİTAMİNLİ YEM SAN.A.Ş.	-	-	-	-	50.630,00	16,281899	31/12/19	-	-	18,570000	-	940.199,10	2,40	0,35
BIMAS	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	-	-	-	54.000,00	43,287015	31/12/19	-	-	46,660000	-	2.519.640,00	6,44	0,93
CEMTS	ÇEMTAŞ ÇELİK MAKİNA SAN VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	195.000,00	5,659714	28/11/19	-	-	8,280000	-	1.614.600,00	4,13	0,59
ECILC	ECZACIBAŞI İLAÇ SİNAİ ve FİNANSAL YATIRIMLAR	-	-	-	-	270.000,00	3,361520	13/12/19	-	-	3,710000	-	1.001.700,00	2,56	0,37
ECILC	ECZACIBAŞI İLAÇ SİNAİ ve FİNANSAL YATIRIMLAR	-	-	-	-	28.000,00	3,710000	31/12/19	-	-	3,710000	-	103.880,00	0,27	0,04
EGEEN	EGE ENDÜSTRİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	3.425,00	453,285025	05/12/19	-	-	580,500000	-	1.988.212,50	5,09	0,73
EGSER	EGE SERAMİK SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	300.240,00	3,085147	27/12/19	-	-	3,710000	-	1.113.890,40	2,85	0,41
ERBOS	ERBOSAN ERCİYES BORU SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	0,41	17,024390	21/06/19	-	-	24,980000	-	10,24	0,00	0,00
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	-	-	-	285.000,00	7,388682	31/12/19	-	-	9,040000	-	2.576.400,00	6,59	0,95
FROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	36.200,00	59,403536	31/12/19	-	-	70,850000	-	2.564.770,00	6,56	0,94
GENTS	GENTAŞ GENEL METAL SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	793.724,00	1,787903	30/12/19	-	-	2,190000	-	1.738.255,56	4,45	0,64
HLGYO	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	-	-	-	-	819.261,00	1,098497	30/12/19	-	-	1,220000	-	999.498,42	2,56	0,37
ISDMR	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	-	-	-	272.000,00	6,431564	31/12/19	-	-	8,010000	-	2.178.720,00	5,57	0,80
KERVY	KEREVİTAŞ GIDA SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	196.302,00	2,891316	30/12/19	-	-	3,260000	-	639.944,52	1,64	0,24
KFEIN	KAFEİN YAZILIM TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	67.500,00	11,186126	27/12/19	-	-	11,140000	-	751.950,00	1,92	0,28
KFEIN	KAFEİN YAZILIM TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	2.000,00	11,323025	30/12/19	-	-	11,140000	-	22.280,00	0,06	0,01
KNFRT	KONFRUT GIDA SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	147.174,00	7,293244	02/12/19	-	-	7,820000	-	1.150.900,68	2,94	0,42
KUTPO	KÜTAHYA PORSELEN SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	59.138,00	4,983537	25/11/19	-	-	6,620000	-	391.493,56	1,00	0,14
LOGO	LOGO YAZILIM SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	28.441,00	38,319989	09/12/19	-	-	60,800000	-	1.729.212,80	4,42	0,64
LOGO	LOGO YAZILIM SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	5.500,00	58,234100	30/12/19	-	-	60,800000	-	334.400,00	0,86	0,12
MAVI	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	44.200,00	37,553680	31/12/19	-	-	57,900000	-	2.559.180,00	6,55	0,94
ORGE	ORGE ELEKTRİK ENERJİ TAHHÜT A.Ş.	-	-	-	-	112.597,00	3,366266	27/12/19	-	-	4,960000	-	558.481,12	1,43	0,21
PETUN	PINAR ENTEGRE ET ve UN SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	90.000,00	6,044696	03/12/19	-	-	9,170000	-	825.300,00	2,11	0,30
SELEC	SELÇUK ECZA DEPOSU TİC.VE SAN.A.Ş.	-	-	-	-	326.303,00	4,488122	31/12/19	-	-	6,100000	-	1.990.448,30	5,09	0,73
YATAS	YATAŞ YATAK ve YORGAN SAN.TİC.A.Ş.	-	-	-	-	340.001,00	6,386148	31/12/19	-	-	7,340000	-	2.495.607,34	6,38	0,92
YATAS	YATAŞ YATAK ve YORGAN SAN.TİC.A.Ş.	-	-	-	-	-42.000,00	6,386148	30/12/19	-	-	7,340000	-	-308.280,00	-0,79	-0,11
GRUP TOPLAMI						4.808.623,41							39.096.316,38	100,00	14,39
GRUP TOPLAMI						4.808.623,41							39.096.316,38	100,00	14,39

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Mesul Kişiler	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Mesul Tutumu	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödemesi Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç Iskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kar	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
KATILIM HESABI															
KATILIM HESABI															
TÜRKİYE EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	-	06/01/20	-	11,50	-	12.200.000,00	-	03/12/19	-	-	11,500000	-	12.311.471,23	45,18	4,53
TÜRKİYE FİNANS KATILIM BANKASI A.Ş.	-	10/01/20	-	11,75	-	7.350.000,00	-	26/11/19	-	-	11,750000	-	7.435.179,45	27,28	2,74
TÜRKİYE EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	-	20/01/20	-	9,25	-	1.750.000,00	-	20/12/19	-	-	9,250000	-	1.755.321,92	6,44	0,65
VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	-	24/01/20	-	12,11	-	5.699.922,38	-	05/12/19	-	-	12,110000	-	5.750.982,75	21,10	2,12
GRUP TOPLAMI						26.999.922,38							27.252.955,35	100,00	10,04
GRUP TOPLAMI						26.999.922,38							27.252.955,35	100,00	10,04
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
TRD120220T16	HAZINE	12/02/20	-	0,00	-	43.970.000,00	101,378100	31/12/19	9,454941	-	105,260050	-	46.282.844,17	22,54	17,04
TRD230920T24	HAZINE	23/09/20	-	0,00	-	40.130.000,00	108,071500	25/12/19	10,176468	-	116,479913	-	47.209.300,88	23,01	17,36
TRD101120T19	HAZINE	18/11/20	-	0,00	-	34.710.000,00	101,142200	10/07/19	10,538588	-	108,345739	-	37.606.806,12	18,32	13,84
TRD100221T17	HAZINE	10/02/21	-	0,00	-	32.840.000,00	100,119500	22/05/19	10,971968	-	113,853474	-	37.389.480,95	18,21	13,76
TRD160621T17	HAZINE	16/06/21	-	0,00	-	2.450.000,00	119,426400	31/12/19	9,957325	-	115,997166	-	2.841.930,57	1,38	1,05
TRD140721T18	HAZINE	14/07/21	-	0,00	-	750.000,00	102,389600	03/12/19	9,878910	-	104,023855	-	780.178,91	0,38	0,29
TRD100821T13	HAZINE	18/08/21	-	0,00	-	40.000,00	112,904400	27/12/19	9,886721	-	113,029184	-	45.211,67	0,02	0,02
TRD220921T16	HAZINE	22/09/21	-	0,00	-	6.950.000,00	122,004000	13/12/19	1,807375	-	156,420718	-	10.871.239,93	5,30	4,00
TRD100822T10	HAZINE	10/08/22	-	0,00	-	12.630.000,00	100,209600	20/11/19	10,021908	-	106,386830	-	13.436.656,57	6,54	4,95
TRD121022T14	HAZINE	12/10/22	-	0,00	-	3.900.000,00	112,246700	03/09/18	3,300211	-	139,111642	-	5.425.354,05	2,64	2,00
GRUP TOPLAMI						178.770.000,00							201.889.011,82	98,34	74,31
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDBRKT22030	BEREKET VARLIK KİR/	28/02/20	-	0,00	-	1.870.000,00	100,313300	03/12/19	10,154495	-	101,343700	-	1.895.127,19	0,92	0,70
TRDBRKT42012	BEREKET VARLIK KİR/	15/04/20	-	3,92	-	1.500.000,00	100,000000	04/12/19	10,681753	-	100,927058	-	1.513.905,87	0,74	0,56
GRUP TOPLAMI						3.370.000,00							3.409.033,06	1,66	1,26
GRUP TOPLAMI						182.140.000,00							205.298.044,88	100,00	75,57
FON PORTFÖY DEĞERİ													271.647.116,61		100,00

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM KATKI 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	271.647.317	-	99,99	177.192.878	-	100,01
B.HAZIR DEĞERLER	31.678	-	0,01	1.487	-	0,00
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	31.678	100,00	0,01	1.487	100,00	0,00
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	536.888	-	0,20	40.790	-	0,02
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	335.660	-	0,16	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) İleri Valörlü Takas Alacakları	103.900	-	-	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	97.327	-	0,04	40.790	-	0,02
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	(531.015)	-	(0,20)	(54.602)	-	(0,03)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	(342.934)	-	0,00	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(78.262)	14,74	(0,03)	(49.469)	90,60	(0,03)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) İhbarlı Fon Pay Takası	-	-	-	-	-	-
h) Diğer Borçlar	(5.940)	1,12	0,00	(5.133)	9,40	0,00
i) Denetim Ücreti	-	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	(1.692)	-	0,00	(949)	-	0,00
vii) Diğer	(4.248)	-	0,00	(4.184)	-	0,00
i) Kayda Alma Ücreti	-	-	-	-	-	-
j) İleri Valörlü Takas Borçları	(103.880)	-	0,00	-	-	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	271.684.866	-	100,00	177.180.554	-	100,00