

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 1 DEĞİŞKEN GRUP 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.
PERA 1 DEĞİŞKEN GRUP
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. Pera 1 Değişken Grup 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. Pera 1 Değişken Grup 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.
PERA 1 DEĞİŞKEN GRUP 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.
PERA 1 DEĞİŞKEN GRUP 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 Odeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Iskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
ODAS	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	0,20	1,90	20/02/19	-	-	2,10	-	0,42	7,84	0,00
SİSE	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	-	-	-	-	0,73	4,90	02/12/19	-	-	5,27	-	3,85	71,82	0,00
TSKB	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	0,90	0,84	01/02/19	-	-	1,21	-	1,09	20,34	0,00
GRUP TOPLAMI						1,83							5,36	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1,83							5,36	100,00	0,00
BORÇLANMA SENETLERİ															
Bono															
TRB220120T17	HAZINE	22/01/20	-	0,00	-	6.000.000,00	98,20	26/11/19	10,65	-	99,42	-	5.965.173,36	24,84	18,90
TRT071020T23	HAZINE	07/10/20	-	0,00	-	3.500.000,00	90,58	16/12/19	11,27	-	92,13	-	3.224.618,62	13,43	10,21
GRUP TOPLAMI						9.500.000,00							9.189.791,98	38,27	29,11
Devlet Tahvil															
TRT150120T16	HAZINE	-	-	0,00	-	500.000,00	95,08	01/11/19	10,43	-	104,84	-	524.224,37	2,18	1,66
TRT050220T17	HAZINE	-	-	0,00	-	3.500.000,00	102,01	11/12/19	10,54	-	102,71	-	3.594.787,04	14,97	11,39
TRT130520T14	HAZINE	-	-	0,00	-	1.000.000,00	82,03	14/06/19	10,67	-	96,37	-	963.747,54	4,01	3,05
TRT020322T17	HAZINE	-	-	0,00	-	1.500.000,00	80,00	22/05/19	11,71	-	102,90	-	1.543.458,32	6,43	4,89
GRUP TOPLAMI						6.500.000,00							6.626.217,27	27,59	20,99
ÖZEL SEKTÖR															
Özel Sektör Tahvil															
TRSKFTF42016	KOÇ FİNANSMAN	30/04/20	-	0,00	-	1.000.000,00	99,67	11/03/19	17,16	-	102,40	-	1.023.960,90	4,26	3,24
TRSOPAS22111	OPET PETROLCÜLÜK A.Ş.	18/02/21	-	14,64	-	500.000,00	100,00	22/02/18	14,91	-	101,04	-	505.208,02	2,10	1,60
TRSOPAS22129	OPET PETROLCÜLÜK A.Ş.	19/02/21	-	24,81	-	1.000.000,00	100,00	22/02/19	14,10	-	102,40	-	1.024.010,88	4,26	3,24
TRSKALE62114	KALESERAMİK ÇANAKKALE KALEBODUR SERAMİK SANAYİ A.Ş.	17/06/21	-	21,56	-	360.000,00	100,00	21/06/18	17,96	-	98,11	-	353.196,42	1,47	1,12
GRUP TOPLAMI						2.860.000,00							2.906.376,22	12,09	9,20
GRUP TOPLAMI						2.860.000,00							2.906.376,22	12,09	9,20
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet															
TRPAK5F12011	AKTİF YATIRIM BANKASI A.Ş.TURKCELL VARLIK FİNANSMAN FONU	14/01/20	-	0,00	-	1.500.000,00	89,81	18/07/19	24,34	-	99,23	-	1.488.405,65	6,20	4,71
TRPAKT292019	TURKCELL FİNANSMAN A.Ş.	14/01/20	-	0,00	-	3.000.000,00	92,24	25/12/19	11,41	-	92,43	-	2.772.898,75	11,55	8,78
GRUP TOPLAMI						4.500.000,00							4.261.304,40	17,75	13,49
GRUP TOPLAMI						23.360.000,00							22.983.689,87	95,70	72,79

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 1 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutar	Birim Günlük Deger Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	
T.REPO															
TRT020823T11	HAZINE	02/01/20	-	11,25	-	2.501.541,10	11,25	31/12/19	-	1.283.775,00	11,38	-	2.500.761,53	100,00	7,92
GRUP TOPLAMI						2.501.541,10						2.500.761,53	100,00	7,92	
GRUP TOPLAMI						2.501.541,10						2.500.761,53	100,00	7,92	
MEVDUAT															
YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.		03/01/20	-	11,75	-	594.000,00	-	21/11/19	-	-	11,75	-	601.835,91	16,41	1,91
ANADOLUBANK A.S.		28/01/20	-	10,50	-	1.576.542,44	-	27/12/19	-	-	10,50	-	1.578.766,88	43,06	5,00
TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.		13/02/20	-	12,50	-	1.462.786,67	-	15/11/19	-	-	12,50	-	1.486.160,75	40,53	4,71
GRUP TOPLAMI						3.633.329,11						3.666.763,54	100,00	11,62	
GRUP TOPLAMI						3.633.329,11						3.666.763,54	100,00	11,62	
TPP															
TPP		02/01/20	-	-	-	1.390.822,58	10,80	31/12/19	-	-	10,78	-	1.390.411,99	100,00	4,40
GRUP TOPLAMI						1.390.822,58						1.390.411,99	100,00	4,40	
GRUP TOPLAMI						1.390.822,58						1.390.411,99	100,00	4,40	
VIOP USD Nakit Teminatı															
VIOP USD Nakit Teminatı		-	-	-	-	0,00	-	-	-	-	-	-	0,00	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						0,00						0,00	100,00	0,00	
GRUP TOPLAMI						0,00						0,00	100,00	0,00	

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 1 DEĞİŞKEN GRUP 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 Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
DİĞER															
Döviz															
USD	ABD HAZİNE	-	-	-	-	277,30	5,73	31/12/19	-	-	5,94	-	1.647,16	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						277,30							1.647,16		
GRUP TOPLAMI						277,30							1.647,16		
KİRA SERTİFİKALARI															
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDHVKA22013	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.	-	-	4,56	-	1.000.000,00	100,00	08/10/19	14,67	-	103,24	-	1.032.393,65	4,30	3,27
GRUP TOPLAMI						1.000.000,00							1.032.393,65	4,30	3,27
GRUP TOPLAMI						1.000.000,00							1.032.393,65	4,30	3,27
FON PORTFÖY DEĞERİ													31.574.026,50		100,00

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 1 DEĞİŞKEN GRUP 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	31.574.027	-	100,10	29.200.430	-	101,28
B,HAZIR DEĞERLER	5.777	-	0,02	2.983	-	0,01
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	4.130	71,49	0,01	2.983	100,00	0,01
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	1.647	28,51	0,01	-	-	-
C,ALACAKLAR	764.218	-	2,42	103.724	-	0,36
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	764.218	-	2,42	103.724	-	0,36
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(801.658)	-	(2,54)	(474.578)	-	(1,65)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(19.374)	2,42	(0,06)	(16.980)	3,58	(0,06)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) İhbarlı Fon Pay Takas	(14.008)	-	0,00	(44.008)	-	0,00
h) Diğer Borçlar	(767.329)	95,84	(2,43)	(412.724)	87,15	(1,43)
i) Denetim Ücreti	-	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	(607)	-	-	(944)	-	0,00
vii) Diğer	(766.722)	-	(2,43)	(411.780)	-	(1,43)
i) Kayda Alma Ücreti	(947)	0,12	0,00	(865)	0,18	0,00
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	31.542.364	-	100,00	28.832.559		100,00