

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 3 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 3 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 3 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 3 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 3 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

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

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 3 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	Nominal Menkul Tammı	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 (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
AKBNK	AKBANK T.A.Ş.	-	-	-	-	65.000,00	7,30	17/01/19	-	-	8,11	-	527.150,00	9,53	2,75
AKGRT	AKSİGORTA A.Ş.	-	-	-	-	25.000,00	3,73	23/10/19	-	-	6,09	-	152.250,00	2,75	0,79
ARCLK	ARÇELİK A.Ş.	-	-	-	-	8.050,00	18,03	23/10/19	-	-	20,84	-	167.762,00	3,03	0,87
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SAN. ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	5.000,00	25,59	27/05/19	-	-	20,94	-	104.700,00	1,89	0,55
BIMAS	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	-	-	-	4.000,00	36,42	23/10/19	-	-	46,66	-	186.640,00	3,37	0,97
ENJSA	ENERJISA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	-	-	-	-	3.000,00	6,54	27/05/19	-	-	7,39	-	22.170,00	0,40	0,12
GARAN	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	57.250,00	10,54	23/10/19	-	-	11,14	-	637.765,00	11,53	3,32
HEKTS	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.	-	-	-	-	37.500,00	3,11	04/11/19	-	-	8,02	-	300.750,00	5,44	1,57
ISCTR	T.IS BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	20.000,00	5,99	23/10/19	-	-	6,41	-	128.200,00	2,32	0,67
KCHOL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	-	-	-	-	8.000,00	15,16	15/08/18	-	-	20,32	-	162.560,00	2,94	0,85
KOZAL	KOZA ALTIN İŞL.A.Ş.	-	-	-	-	1.000,00	36,22	23/10/19	-	-	74,05	-	74.050,00	1,34	0,39
KRDMD	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	-	-	-	20.000,00	2,25	02/07/19	-	-	2,66	-	53.200,00	0,96	0,28
MGROS	MİGROS TİC.A.Ş.	-	-	-	-	4.000,00	19,84	23/10/19	-	-	24,22	-	96.880,00	1,75	0,51
PETKM	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.	-	-	-	-	29.800,00	3,41	23/10/19	-	-	3,81	-	113.538,00	2,05	0,59
PGSUS	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	-	-	-	2.100,00	27,54	23/10/19	-	-	86,40	-	181.440,00	3,28	0,95
SISE	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	-	-	-	-	30.000,00	4,52	23/10/19	-	-	5,27	-	158.100,00	2,86	0,82
SODA	SODA SANAYİİ A.Ş.	-	-	-	-	10.000,00	6,11	27/05/19	-	-	6,18	-	61.800,00	1,12	0,32
TCCELL	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.	-	-	-	-	27.000,00	14,29	23/10/19	-	-	13,80	-	372.600,00	6,74	1,94
THYAO	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	-	-	-	19.000,00	13,19	23/10/19	-	-	14,46	-	274.740,00	4,97	1,43
TOASO	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.	-	-	-	-	6.000,00	17,47	02/09/19	-	-	26,86	-	161.160,00	2,91	0,84
TRKCM	TRAKYA CAM SANAYİİ A.Ş.	-	-	-	-	353,98	4,00	05/12/18	-	-	3,50	-	1.238,93	0,02	0,01
TTKOM	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	-	-	-	25.000,00	4,82	02/07/19	-	-	7,37	-	184.250,00	3,33	0,96
TUPRS	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	-	-	-	2.400,00	128,38	02/09/19	-	-	126,80	-	304.320,00	5,50	1,59
ULKER	ÜLKER GIDA SAN. VE TİC. A.Ş.	-	-	-	-	7.000,00	17,57	27/05/19	-	-	22,36	-	156.520,00	2,83	0,82
YKBNK	YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	65.000,00	2,19	02/07/19	-	-	2,48	-	161.200,00	2,91	0,84
GRUP TOPLAMI						481.453,98							4.744.983,93		
Hisse Yabancı															
VOO	Vanguard S&P 500 ETF	-	-	-	-	295,00	256,20	16/05/19	-	-	295,04	-	516.998,59	9,35	2,69
VWO	Vanguard FTSE Emerging Markets Index Fund ETF	-	-	-	-	1.025,00	42,01	04/11/19	-	-	44,36	-	270.085,86	4,88	1,41
GRUP TOPLAMI						1.320,00							787.084,45	14,23	4,10
GRUP TOPLAMI						482.773,98							5.532.068,38	100,00	28,85

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 3 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 Menkul Tarihi Tamamı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Zinlük Degeri	Kur	Toplam Degeri	Grup (%)	Toplam (%)		
BORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvili																
TRT160920T25	HAZINE	16/09/20	-	0,00	-	500.000,00	87,80	14/10/19	11,31	-	92,68	-	463.400,99	5,00	2,42	
TRT220921T18	HAZINE	22/09/21	-	0,00	-	2.000.000,00	90,30	11/10/19	11,61	-	99,28	-	1.985.597,59	21,40	10,33	
TRT180123T10	HAZINE	18/01/23	-	12,57	-	200.000,00	100,23	22/05/19	11,66	-	107,64	-	215.275,03	2,32	1,12	
TRT240724T15	HAZINE	24/07/24	-	0,00	-	1.500.000,00	91,10	06/11/19	12,24	-	93,94	-	1.409.050,70	15,19	7,34	
GRUP TOPLAMI						4.200.000,00						4.073.324,31	43,91	21,21		
Özel Sektör																
Finansman Bonosu																
TRFTCZB82013	T.C. ZİRAAT BANKASI A.Ş.	27/08/20	-	19,77	-	530.000,00	100,00	29/08/19	0,00	-	102,22	-	541.776,98	5,84	2,82	
GRUP TOPLAMI						530.000,00						541.776,98	5,84	2,82		
Özel Sektör Tahvil																
TRSTPRS12115	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	22/01/21	-	25,29	-	300.000,00	100,000000	25/01/19	16,705394	-	103,052928	-	309.158,78	3,33	1,61	
TRSOTKO32110	OTOKOÇ OTOMOTIV TİC VE SAN A.Ş.	15/03/21	-	24,78	-	400.000,00	100,000000	18/03/19	14,113607	-	100,680592	-	402.722,37	4,34	2,10	
TRSERGL52117	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	28/05/21	-	26,89	-	500.000,00	100,000000	31/05/19	13,868968	-	101,723191	-	508.615,96	5,48	2,65	
TRSDOGH72112	DOĞUŞ HOLDİNG A.Ş.	26/07/21	-	16,77	-	710.000,00	100,000000	20/10/17	32,473328	-	90,550305	-	642.907,17	6,93	3,35	
TRSAVGZ82118	AYGAZ A.Ş.	04/08/21	-	19,39	-	190.000,00	100,000000	07/08/19	15,263964	-	102,203396	-	194.186,45	2,09	1,01	
TRSENSA72211	ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	26/07/22	-	5,00	-	640.000,00	100,000000	01/08/17	5,073670	-	143,227334	-	916.654,94	9,88	4,78	
TRSTİSB72712	T.İS BANKASI A.Ş.	27/07/27	-	13,91	-	600.000,00	100,000000	03/07/19	16,978394	-	102,189040	-	613.134,24	6,61	3,20	
TRSYKBK62914	T.C. ZİRAAT BANKASI A.Ş.	20/06/29	-	25,46	-	300.000,00	100,000000	03/07/19	17,530291	-	104,110043	-	312.330,13	3,37	1,63	
GRUP TOPLAMI						3.640.000,00						3.899.710,04				
GRUP TOPLAMI						4.170.000,00						4.441.487,02				
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet																
TRPAKT262012	TURKCELL FİNANSMAN A.Ş.	16/06/20	-	0,00	-	800.000,00	95,10	25/12/19	11,11	-	95,30	-	762.366,96	8,22	3,97	
GRUP TOPLAMI						800.000,00						762.366,96	8,22	3,97		
GRUP TOPLAMI						9.170.000,00						9.277.178,29	100,00	48,33		
T.REPO																
TRT030523T13	HAZINE	02/01/20	-	11,36	-	500.311,23	11,360000	31/12/19		274.290,00		11,380000	-	500.155,32	100,00	2,61
GRUP TOPLAMI						500.311,23						500.155,32	100,00	2,61		
GRUP TOPLAMI						500.311,23						500.155,32	100,00	2,61		

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 3 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 Ödemesi Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Repo İskonto Oranı	Repo Tutar	Günlük Birim Günlük Değer Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)	
MEVDUAT															
YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.		06/01/20	-	1,95	-	32.054,71	-	03/12/19	-	-	1,950000	-	190.699,78	17,60	0,99
YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.		31/01/20	-	2,10	-	150.244,52	-	30/12/19	-	-	2,100000	-	892.550,70	82,40	4,65
GRUP TOPLAMI						182.299,23							1.083.250,48	100,00	5,64
GRUP TOPLAMI						182.299,23							1.083.250,48	100,00	5,64
TPP															
TPP		02/01/20	-	10,25	-	323.181,41	10,250000	31/12/19	-	-	10,780000	-	323.086,00	38,42	1,68
TPP		14/01/20	-	16,00	-	519.945,21	16,000000	15/10/19	-	-	10,850000	-	517.943,97	61,58	2,70
GRUP TOPLAMI						843.126,62							841.029,97	100,00	4,38
GRUP TOPLAMI						843.126,62							841.029,97	100,00	4,38
DİĞER															
Y.Fonu Yabancı															
DJSXE	ISHARES EURO STOXX 50	-	-	-	-	1.300,00	32,77	16/05/19	-	-	37,82	-	327.548,81	20,61	1,71
EEM	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	-	-	-	-	2.550,00	42,35	19/11/19	-	-	44,77	-	678.131,19	42,67	3,53
EMB	JP MORGAN CHASE BANK NA MERK COLOH	-	-	-	-	5,00	110,79	24/10/19	-	-	114,55	-	3.402,14	0,21	0,02
EWJ	ISHARES MSCI JAPAN ETF	-	-	-	-	600,00	52,46	25/02/19	-	-	59,05	-	210.454,20	13,24	1,10
VGK US EQUITY	VANGUARD GROUP	-	-	-	-	1.070,00	54,91	12/04/19	-	-	58,19	-	369.844,00	23,27	1,93
GRUP TOPLAMI						5.525,00							1.589.380,34	100,00	8,29
GRUP TOPLAMI						5.525,00							1.589.380,34	100,00	8,29
TÜREV															
Futures															
Kısa															
F_USDTRY0120		-	-	-	-	41,00	5,99	30/12/19	-	-	6,00	-	246.028,70	0,00	0,00
F_XU0300220		-	-	-	-	140,00	141,30	30/12/19	-	-	141,30	-	1.978.200,00	0,00	0,00
Uzun															
F_EURUSD0120		-	-	-	-	25,00	1,12	31/12/19	-	-	1,12	-	166.988,25	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						206,00							2.391.216,95		
GRUP TOPLAMI						206,00							2.391.216,95		
VIOP Nakit Teminatı															
VIOP Nakit Teminatı		-	-	-	-	363.855,29	-	-	-	-	-	-	363.855,29	100,00	1,90
GRUP TOPLAMI						363.855,29							363.855,29	100,00	1,90
GRUP TOPLAMI						363.855,29							363.855,29	100,00	1,90
DİĞER															
Döviz															
EUR	EU	-	-	-	-	209,94	6,56	31/12/19	-	-	6,66	-	1.398,64	0,00	0,00
USD	ABD HAZİNE	-	-	-	-	22.699,97	5,92	31/12/19	-	-	5,94	-	134.837,82	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						22.909,91							136.236,46	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						22.909,91							136.236,46	0,00	0,00
FON PORTFÖY DEĞERİ												19.186.918,67		100,00	

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PERA 3 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	19.186.918	-	99,01	16.304.911	-	98,86
B,HAZIR DEĞERLER	142.357	-	0,73	151.419	-	0,92
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	6.121	4,30	0,03	3.156	2,08	0,02
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	136.237	95,70	0,70	148.263	97,92	0,90
C,ALACAKLAR	72.918	-	0,38	72.918	-	0,44
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	72.918	-	0,38	72.918	-	0,44
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(22.776)	-	(0,12)	(36.600)	-	(0,22)
a) Takasa Borçlar T1	0	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(11.789)	51,76	(0,06)	(9.756)	26,66	(0,06)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) İhbarlı Fon Pay Takas	(7.217)	-	-	(21.328)	-	0,00
h) Diğer Borçlar	(3.189)	16,55	(0,02)	(5.022)	15,07	(0,03)
i) Denetim Ücreti	-	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	(606)	-	-	(944)	-	(0,01)
vii) Diğer	(2.582)	-	(0,01)	(4.078)	-	(0,02)
i) Kayda Alma Ücreti	(581)	2,55	-	(495)	1,35	0,00
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	19.379.417	-	100,00	16.492.648	-	100,00