

VAKIF 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



**VAKIF 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**

Vakıf 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 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. 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 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.
OKS ATA K KATILIM DEĞİŞKEN 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.
OKS ATAK KATILIM DEĞİŞKEN 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 Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
ALCTL	ALCATEL LUCENT TELETAS TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	-	-	-	15.000,00	10,169333	21/11/19	-	-	12,040000	-	180.600,00	4,77	2,02
ALKIM	ALKIM ALKALİ KİMYA A.Ş.	-	-	-	-	4.500,00	25,743760	21/11/19	-	-	38,320000	-	172.440,00	4,55	1,93
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SAN. ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	14.847,00	22,473250	23/12/19	-	-	20,940000	-	310.896,18	8,20	3,47
BANVT	BANVİT BANDIRMANLI VİTAMİNLİ YEM SAN.A.Ş.	-	-	-	-	3.200,00	15,025000	22/11/19	-	-	18,570000	-	59.424,00	1,57	0,66
BIMAS	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	-	-	-	7.512,00	41,871444	23/12/19	-	-	46,660000	-	350.509,92	9,25	3,92
CEMTS	ÇEMTAŞ ÇELİK MAKİNA SAN VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	16.798,00	5,642627	22/11/19	-	-	8,280000	-	139.087,44	3,67	1,55
ECILC	ECZACIBAŞI İLAÇ SİNAİ ve FİNANSAL YATIRIMLAR	-	-	-	-	22.000,00	2,491608	25/11/19	-	-	3,710000	-	81.620,00	2,15	0,91
EGEEN	EGE ENDÜSTRİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	335,00	472,444537	22/11/19	-	-	580,500000	-	194.467,50	5,13	2,17
EGSER	EGE SERAMİK SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	13.961,00	3,329230	02/12/19	-	-	3,710000	-	51.795,31	1,37	0,58
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	-	-	-	40.913,00	8,676939	23/12/19	-	-	9,040000	-	369.853,52	9,76	4,13
FROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	5.119,00	55,298408	23/12/19	-	-	70,850000	-	362.681,15	9,57	4,05
GENTS	GENTAŞ GENEL METAL SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	35.000,00	1,500000	22/11/19	-	-	2,190000	-	76.650,00	2,02	0,86
HLGYO	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	-	-	-	-	45.000,00	1,010000	22/11/19	-	-	1,220000	-	54.900,00	1,45	0,61
ISDMR	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	-	-	-	22.000,00	6,706640	24/12/19	-	-	8,010000	-	176.220,00	4,65	1,97
KERVT	KEREVİTAŞ GIDA SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	17.000,00	2,800000	22/11/19	-	-	3,260000	-	55.420,00	1,46	0,62
KFEIN	KAFEİN YAZILIM TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	6.500,00	9,260769	26/11/19	-	-	11,140000	-	72.410,00	1,91	0,81
KNFRT	KONFRUT GIDA SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	6.500,00	7,153483	22/11/19	-	-	7,820000	-	50.830,00	1,34	0,57
KUTPO	KÜTAHYA PORSELEN SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	6.214,00	4,163944	22/05/19	-	-	6,620000	-	41.136,68	1,09	0,46
LOGO	LOGO YAZILIM SANAYİ ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	2.717,00	38,956831	24/09/19	-	-	60,800000	-	165.193,60	4,36	1,85
MAVI	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	5.959,00	34,686395	26/08/19	-	-	57,900000	-	345.026,10	9,11	3,86
ORGE	ORGE ELEKTRİK ENERJİ TAHHÜT A.Ş.	-	-	-	-	13.035,00	2,873307	22/11/19	-	-	4,960000	-	64.653,60	1,71	0,72
PETUN	PİNAR ENTEGRE ET ve UN SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	8.101,00	5,624213	22/05/19	-	-	9,170000	-	74.286,17	1,96	0,83
SELEC	SELÇUK ECZA DEPOSU TİC.VE SAN.A.Ş.	-	-	-	-	23.774,00	3,856522	26/08/19	-	-	6,100000	-	145.021,40	3,83	1,62
YATAS	YATAŞ YATAK ve YORGAN SAN.TİC.A.Ş.	-	-	-	-	26.452,00	4,287621	22/11/19	-	-	7,340000	-	194.157,68	5,12	2,17
GRUP TOPLAMI						362.437,00							3.789.280,25	100,00	42,34
GRUP TOPLAMI						362.437,00							3.789.280,25	100,00	42,34

VAKIF 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	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tamamı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Ağı Fiyatı	Satın Ağı Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
TRD120220T16	HAZINE	12/02/20	-	0,00	-	680.000,00	103,74	26/12/19	9,45	-	105,26	-	715.768,34	13,87	8,00
TRD230920T24	HAZINE	23/09/20	-	0,00	-	650.000,00	116,00	25/12/19	10,18	-	116,48	-	757.119,44	14,67	8,46
TRD181120T19	HAZINE	18/11/20	-	0,00	-	70.000,00	107,65	17/05/19	10,54	-	108,35	-	75.842,02	1,47	0,85
TRD100221T17	HAZINE	10/02/21	-	0,00	-	670.000,00	102,34	26/08/19	10,97	-	113,85	-	762.818,28	14,80	8,52
TRD160621T17	HAZINE	16/06/21	-	0,00	-	220.000,00	102,31	12/12/19	9,96	-	116,00	-	255.193,77	4,95	2,85
TRD140721T18	HAZINE	14/07/21	-	0,00	-	270.000,00	94,35	03/12/19	9,88	-	104,02	-	280.864,41	5,44	3,14
TRD220921T16	HAZINE	22/09/21	-	0,00	-	20.000,00	154,43	13/12/19	1,81	-	156,42	-	31.284,14	0,61	0,35
TRD070623T16	HAZINE	07/06/23	-	0,00	-	100.000,00	122,03	28/03/19	2,74	-	130,61	-	130.605,51	2,53	1,46
GRUP TOPLAMI						2.680.000,00							3.009.495,91	58,34	33,63
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDHVK12022	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	07/01/20	-	4,57	-	700.000,00	100,00	17/09/19	15,68	-	104,32	-	730.252,99	14,15	8,16
TRDVVRK22018	VAKIF VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12/02/20	-	3,09	-	200.000,00	100,00	06/11/19	9,90	-	101,97	-	203.948,72	3,95	2,28
TRDZVK22014	ZİRAAT KATILIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	21/02/20	-	3,15	-	600.000,00	100,00	15/11/19	10,16	-	101,77	-	610.613,91	11,83	6,82
TRDBRKT22030	BEREKET VARLIK KİRALAMA A.Ş.	28/02/20	-	2,91	-	50.000,00	100,00	22/11/19	10,15	-	101,34	-	50.671,85	0,98	0,57
TRDBRKT42012	BEREKET VARLIK KİRALAMA A.Ş.	15/04/20	-	3,92	-	100.000,00	100,00	04/12/19	10,68	-	100,93	-	100.927,06	1,96	1,13
TRDHVKA52010	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	12/05/20	-	4,39	-	100.000,00	100,00	17/12/19	11,26	-	100,44	-	100.439,35	1,95	1,12
TRDHVKA52028	KAYSERİ ŞEKER FABRİKASI A.Ş.	14/05/20	-	4,51	-	150.000,00	100,00	26/12/19	12,18	-	100,19	-	150.283,66	2,91	1,68
TRDKTLM22014	KATILIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12/02/20	-	0,00	-	100.000,00	101,78	31/12/19	14,27	-	101,82	-	101.821,21	1,97	1,14
TRDKTLM52011	KATILIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	27/05/20	-	18,40	-	100.000,00	100,00	28/05/18	14,54	-	101,15	-	101.153,64	1,96	1,13
GRUP TOPLAMI						2.100.000,00							2.150.112,39	41,66	24,03
GRUP TOPLAMI						4.780.000,00							5.159.608,30	100,00	57,66
FON PORTFÖY DEĞERİ													8.948.888,55		

VAKIF 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	8.948.889		100,95	3.655.384	-	91,30
B,HAZIR DEĞERLER	10.099	-	0,11	29.991	-	0,75
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	10.099	100,00	0,11	29.991	100,00	0,75
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C,ALACAKLAR	-	-	-	357.108	-	8,92
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	350.773	-	8,76
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-	6.335	-	0,16
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(93.904)	-	(1,06)	(38.801)	-	(0,97)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(5.706)	6,08	0,00	(2.661)	6,86	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) İhbarlı Fon Pay Takas	(36.029)	-	-	(31.713)	-	0,00
h) Diğer Borçlar	(51.904)	55,56	(0,59)	(4.315)	11,43	(0,11)
i) Denetim Ücreti	-	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	(605)	-	(0,01)	(943)	-	(0,02)
vii) Diğer	(51.299)	-	(0,58)	(3.373)	-	(0,08)
i) Kayda Alma Ücreti	(266)	0,28	0,00	(120)	0,31	0,00
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	8.865.083	-	100,00	4.003.682	-	100,00