

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ 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 DENGELİ 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 Dengeli 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 Dengeli 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 DENGELİ DEĞİŞKEN 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.
OKS DENGELİ 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 Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
AKBNK	AKBANK T.A.Ş.	-	-	-	-	4.519,00	6,58	12/30/2019	-	-	8,11	-	36.649,09	8,26	2,67
ARCLK	ARÇELİK A.Ş.	-	-	-	-	605,00	19,34	12/30/2019	-	-	20,84	-	12.608,20	2,84	0,92
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SAN. ve TİC.A.Ş.	-	-	-	-	814,00	21,62	12/30/2019	-	-	20,94	-	17.045,16	3,84	1,24
BIMAS	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	-	-	-	389,00	41,34	12/30/2019	-	-	46,66	-	18.150,74	4,09	1,32
EKGYO	EMLAK KONUT GAYR.YAT.ORT.A.Ş.	-	-	-	-	5.647,00	1,41	12/30/2019	-	-	1,46	-	8.244,62	1,86	0,60
ENJSA	ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	-	-	-	-	585,00	5,60	12/30/2019	-	-	7,39	-	4.323,15	0,97	0,32
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	-	-	-	3.604,00	8,13	12/30/2019	-	-	9,04	-	32.580,16	7,34	2,38
PROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	116,00	52,60	12/30/2019	-	-	70,85	-	8.218,60	1,85	0,60
GARAN	T.GARANTİ BANKASI A.S.	-	-	-	-	3.697,00	8,84	12/30/2019	-	-	11,14	-	41.184,58	9,29	3,00
HALKB	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	622,00	6,25	12/30/2019	-	-	5,91	-	3.676,02	0,83	0,27
ISCTR	T.IS BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	2.604,00	5,64	12/30/2019	-	-	6,41	-	16.691,64	3,76	1,22
KCHOL	KOÇ HOLDING A.Ş.	-	-	-	-	537,00	17,87	12/30/2019	-	-	20,32	-	10.911,84	2,46	0,80
KOZAL	KOZA ALTIN İŞL.A.Ş.	-	-	-	-	111,00	51,30	12/30/2019	-	-	74,05	-	8.219,55	1,85	0,60
KRDMD	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	-	-	-	2.677,00	2,34	12/30/2019	-	-	2,66	-	7.120,82	1,60	0,52
MGROS	MİGROS TİC.A.Ş.	-	-	-	-	323,00	15,48	12/30/2019	-	-	24,22	-	7.823,06	1,76	0,57
OTKAR	OTKAR OTOMOTİV ve SAVUNMA SAN.A.Ş.	-	-	-	-	36,00	114,63	12/30/2019	-	-	159,00	-	5.724,00	1,29	0,42
PETKM	PETKİM PETROKİMYA HOLDING A.Ş.	-	-	-	-	4.195,00	3,70	12/30/2019	-	-	3,81	-	15.982,95	3,60	1,17
SAHOL	SABANCI HOLDING A.Ş.	-	-	-	-	2.061,00	8,99	12/30/2019	-	-	9,54	-	19.661,94	4,43	1,44
SISE	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	-	-	-	-	1.465,00	5,24	12/30/2019	-	-	5,27	-	7.720,55	1,74	0,56
SODA	SODA SANAYİİ A.Ş.	-	-	-	-	1.660,00	6,74	12/30/2019	-	-	6,18	-	10.258,80	2,31	0,75
TAVHL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.	-	-	-	-	129,00	24,12	12/30/2019	-	-	29,18	-	3.764,22	0,85	0,27
TCELL	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.	-	-	-	-	1.854,00	14,27	12/30/2019	-	-	13,80	-	25.585,20	5,77	1,87
THYAO	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	-	-	-	2.148,00	13,73	12/30/2019	-	-	14,46	-	31.060,08	7,00	2,27
TKFEN	TEKFEN HOLDING A.Ş.	-	-	-	-	440,00	21,49	12/30/2019	-	-	19,32	-	8.500,80	1,92	0,62
TOASO	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.	-	-	-	-	362,00	20,29	12/30/2019	-	-	26,86	-	9.723,32	2,19	0,71
TRKCM	TRAKYA CAM SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	1.352,00	3,61	12/30/2019	-	-	3,50	-	4.732,00	1,07	0,35
TTKOM	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	-	-	-	1.514,00	4,53	12/30/2019	-	-	7,37	-	11.158,18	2,51	0,81
TUPRS	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	-	-	-	181,00	129,39	12/30/2019	-	-	126,80	-	22.950,80	5,17	1,67
ULKER	ÜLKER GIDA SAN. VE TİC. A.Ş.	-	-	-	-	301,00	17,97	12/30/2019	-	-	22,36	-	6.730,36	1,52	0,49
VAKBN	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O	-	-	-	-	2.406,00	4,16	12/30/2019	-	-	5,51	-	13.257,06	2,99	0,97
YKBNK	YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	5.443,00	2,24	12/30/2019	-	-	2,48	-	13.498,64	3,04	0,99
GRUP TOPLAMI						52.397,00							443.756,13	100,00	32,39
GRUP TOPLAMI						52.397,00							443.756,13	100,00	32,39

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ 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 (%)
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili															
TRT130520T14	HAZINE	5/13/2020	-	0,00	-	30.000,00	79,99	5/21/2019	10,67	-	96,37	-	28.912,43	4,17	2,11
TRT100620T16	HAZINE	6/10/2020	-	0,00	-	50.000,00	80,49	6/12/2019	11,00	-	95,50	-	47.751,15	6,89	3,48
TRT180123T10	HAZINE	1/18/2023	-	0,00	-	20.000,00	89,04	3/20/2019	11,66	-	107,64	-	21.527,50	3,11	1,57
GRUP TOPLAMI						100.000,00							98.191,08	14,17	7,16
Özel Sektör															
Finansman Bonosu															
TRFFNYM12016	FN	1/8/2020	-	14,15	-	40.000,00	96,63	10/10/2019	14,92	-	99,73	-	39.893,45	5,76	2,91
TRFOYMD12019	OYAK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	1/10/2020	-	13,10	-	40.000,00	97,55	11/1/2019	11,14	-	99,74	-	39.895,93	5,76	2,91
TRFNURL22028	NUROL YATIRIM BANKASI A.Ş.	2/13/2020	-	13,85	-	70.000,00	96,42	11/7/2019	16,19	-	98,25	-	68.773,48	9,92	5,02
TRFTISB32010	T.IS BANKASI A.Ş.	3/5/2020	-	13,98	-	40.000,00	100,00	9/12/2019	0,00	-	100,55	-	40.221,61	5,81	2,94
TRFYKKBK32021	YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.	3/13/2020	-	28,92	-	20.000,00	100,00	9/20/2019	0,00	-	101,12	-	20.223,53	2,92	1,48
TRFTCB32026	T.C. ZİRAAT BANKASI A.Ş.	3/20/2020	-	14,52	-	30.000,00	100,00	9/20/2019	0,00	-	101,21	-	30.364,16	4,38	2,22
TRFVFAS42013	VAKIF FAKTORİNG	4/3/2020	-	10,50	-	50.000,00	97,26	12/27/2019	10,91	-	97,40	-	48.698,03	7,03	3,55
TRFTHAL52017	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	5/6/2020	-	4,26	-	40.000,00	100,00	11/6/2019	0,00	-	101,97	-	40.787,34	5,89	2,98
GRUP TOPLAMI						330.000,00							328.857,53	47,47	24,01
Özel Sektör Tahvil															
TRSTPRS12115	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFINERİ A.Ş.	1/22/2021	-	25,29	-	40.000,00	100,00	1/25/2019	16,71	-	103,05	-	41.221,17	5,95	3,01
TRSISGY12113	İŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	1/25/2021	-	26,51	-	10.000,00	100,00	1/28/2019	18,76	-	103,24	-	10.323,77	1,49	0,75
TRSOPAS22129	OPET PETROLCÜLÜK A.Ş.	2/19/2021	-	0,00	-	30.000,00	101,39	6/10/2019	14,10	-	102,40	-	30.720,33	4,43	2,24
TRSERGL52117	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	5/28/2021	-	26,89	-	30.000,00	100,00	5/31/2019	13,87	-	101,72	-	30.516,96	4,40	2,23
TRSKFTF62113	KOÇ FİNANSMAN	6/10/2021	-	27,45	-	30.000,00	100,00	6/13/2019	14,06	-	101,23	-	30.368,71	4,38	2,22
TRSKCTF62110	KOÇ FİNANSMAN	6/14/2021	-	27,38	-	30.000,00	100,00	6/17/2019	14,09	-	100,59	-	30.176,20	4,36	2,20
TRSMGTI72110	MİGROS TİC.A.Ş.	7/14/2021	-	0,00	-	40.000,00	106,06	4/3/2019	21,37	-	104,42	-	41.768,86	6,03	3,05
TRSVKFB92925	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O	9/14/2029	-	12,96	-	30.000,00	100,00	9/27/2019	16,73	-	99,82	-	29.947,45	4,32	2,18
TRSYKKBK92911	YAPI ve KREDİ BANKASI A.Ş.	9/20/2029	-	17,92	-	20.000,00	100,00	10/3/2019	0,00	-	103,80	-	20.759,44	3,00	1,51
GRUP TOPLAMI						260.000,00							265.802,89	38,36	19,39
GRUP TOPLAMI						590.000,00							594.660,42	85,83	43,40
GRUP TOPLAMI						690.000,00							692.851,50	100,00	50,56

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ DEĞİŞKEN 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	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tamamı	Oran	Ödeme	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Kur	Deger	(%)	(%)
MEVDUAT															
DENİZBANK A.Ş.		1/22/2020	-	10,80	-	60.681,86	-	12/17/2019	-	-	10,80	-	60.949,28	50,03	4,45
TÜRK EKONOMİ BANKASI A.Ş.		1/30/2020	-	10,60	-	60.596,71	-	12/16/2019	-	-	10,60	-	60.875,67	49,97	4,44
GRUP TOPLAMI						121.278,57							121.824,95	100,00	8,89
GRUP TOPLAMI						121.278,57							121.824,95	100,00	8,89
TPP															
TPP		1/2/2020	-	10,80	-	112.066,28	10,80	12/31/2019	-	-	10,78	-	112.033,20	100,00	8,16
GRUP TOPLAMI						112.066,28							112.033,20	100,00	8,16
GRUP TOPLAMI						112.066,28							112.033,20	100,00	8,16
FON PORTFÖY DEĞERİ													1.370.465,78		100,00

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ 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 TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	1.370.466	-	100,92	-	-	-
B.HAZIR DEĞERLER	183	-	0,01	766	-	0,10
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	183	100,00	0,01	766	100,00	0,10
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	3.942	-	0,29	9.940	-	1,35
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	2.795	-	0,00
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	3.942	-	0,29	7.145	-	0,97
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	(16.680)	-	(1,22)	(8.051)	-	(1,09)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(929)	5,57	(0,07)	(486)	6,04	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) İhbarlı Fon Pay Takas	(8.879)	-	0,00	-	-	-
h) Diğer Borçlar	(6.832)	41,20	(0,50)	(4.145)	51,76	(0,56)
i) Denetim Ücreti	-	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	(605)	-	(0,04)	-	-	-
vii) Diğer	(6.227)	-	(0,46)	-	-	-
i) Kayda Alma Ücreti	(41)	0,24	0,00	-	-	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	1.357.911	-	100,00	738.032	-	100,00