

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 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



**KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM 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**

Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. Katılım 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 İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. Katılım 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 İlişkin 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 Katılım 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, 29 Nisan 2021

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.

KATILIM DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	Döviz	İhraççı	Vade	Kalan	Kar Payı	Ödeme	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Net	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	Toplam
Kıymet	Cinsi	Kurum	Tarihi	Gün Oranı	Sayısı	Değer	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Dönüş	Tutarı	Deger	Deger	(%)	Göre (%)	Göre (%)
HİSSE SENETLERİ																	
Hisse Türk																	
ALBRK	TL	ALBARAKA TURK KATILIM BANKASI A.Ş.				5.169.177,00	1,679076	12/22/2020					1,94	10.028.203,38	22,28	7,92	7,94
ALKIM	TL	ALKIM				143.590,49	3,546682	7/7/2020					14,90	2.139.498,30	4,75	1,69	1,69
ALKIM	TL	ALKIM				(55.000,00)	3,546682	12/30/2020					14,90	(819.500,00)	(1,82)	(0,65)	(0,65)
ARZUM	TL	ARZUM				3.113,00	17,000000	12/23/2020					24,62	76.642,06	0,17	0,06	0,06
ASELS	TL	ASELS				62.000,00	17,355795	11/5/2020					18,25	1.131.500,00	2,51	0,89	0,90
ASELS	TL	ASELS				50.000,00	18,690000	12/30/2020					18,25	912.500,00	2,03	0,72	0,72
CEMTS	TL	CEMTS				50.000,00	16,160942	12/30/2020					15,94	797.000,00	1,77	0,63	0,63
CEMTS	TL	CEMTS				50.000,00	16,621525	12/30/2020					15,94	797.000,00	1,77	0,63	0,63
ECILC	TL	ECILC				300.000,00	7,353189	12/28/2020					7,46	2.238.000,00	4,97	1,77	1,77
EGEEN	TL	EGEEN				3.820,00	332,719895	1/30/2018					1.770,10	6.761.782,00	15,02	5,34	5,35
EGEEN	TL	EGEEN				(346,00)	332,719893	12/30/2020					1.770,10	(612.454,60)	(1,36)	(0,48)	(0,48)
EGSER	TL	EGSER				1.000,00	3,641470	3/28/2016					10,29	10.290,00	0,02	0,01	0,01
ENKAI	TL	ENKAI				1,10	3,427273	5/29/2020					7,37	8,11	0,00	0,00	0,00
ERBOS	TL	ERBOS				38,31	9,245628	4/10/2019					41,00	1.570,71	0,00	0,00	0,00
GENTS	TL	GENTS				559.229,17	1,366346	7/7/2020					5,94	3.321.821,27	7,38	2,62	2,63
GENTS	TL	GENTS				(35.000,00)	1,366346	12/30/2020					5,94	(207.900,00)	(0,46)	(0,16)	(0,16)
GOODY	TL	GOODY				0,55	3,400000	2/3/2020					8,36	4,60	0,00	0,00	0,00
HLGYO	TL	HALK GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.				1.143.700,17	2,642054	11/26/2020					3,21	3.671.277,55	8,16	2,90	2,91
KRVGD	TL	KRVGD				40.000,00	9,000000	12/2/2020					13,22	528.800,00	1,17	0,42	0,42
MAVI	TL	MAVI GIYIM				222.799,00	49,645608	7/23/2020					52,20	11.630.107,80	25,83	9,19	9,21
PETUN	TL	PETUN				100,00	9,587300	3/28/2016					23,28	2.328,00	0,01	0,00	0,00
SELEC	TL	SELEC				2.001,00	9,467046	12/11/2020					13,65	27.313,65	0,06	0,02	0,02
TATGD	TL	TATGD				1,00	5,930000	4/30/2020					11,86	11,86	0,00	0,00	0,00
THYAO	TL	THYAO				200.000,00	13,080000	12/22/2020					12,91	2.582.000,00	5,74	2,04	2,04
GRUP TOPLAMI						7.910.224,79								45.017.804,69	100,00	35,56	35,64
GRUP TOPLAMI						7.910.224,79								45.017.804,69	100,00	35,56	35,64
KATILIM HESABI																	
TURKIYE FINANS KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		1/6/2021	2	17,00	3.450.000,00		12/4/2020				3.502.881,15	17,00	3.499.676,23	16,90	2,77	2,77
TURKIYE FINANS KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		12/10/2022	9	17,40	1.000.000,00		12/11/2020				1.015.688,52	17,40	1.011.409,84	4,88	0,80	0,80
ZIRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		1/19/2021	15	17,50	2.400.000,00		12/18/2020				2.436.721,31	17,50	2.419.508,20	11,68	1,91	1,92
VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	USD		1/26/2021	22	2,75	402.112,37		12/25/2020				403.079,20	2,75	2.985.674,14	14,42	2,36	2,36
TURKIYE FINANS KATILIM BANKASI A.Ş.	USD		1/26/2021	22	1,24	37.915,36		12/25/2020				37.956,35	1,24	281.404,26	1,36	0,22	0,22

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.

KATILIM DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	Döviz	İhraççı	Vade	Kalan	Kar Payı	Kar Payı	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Net	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	Toplam
Kıymet	Cinsi	Kurum	Tarihi	Gün	Oranı	Ödeme	Değer	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Dönüş	Birim	Deger	(%)	FPD'ye	FTD'ye
ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		1/2/2021	28	18,00		1.300.000,00		12/28/2020			1.322.377,05	18,00	1.304.475,41	6,30	1,03	1,03
VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	USD		1/2/2021	28	2,75		247.036,46		12/28/2020			247.686,11	2,75	1.833.826,31	8,86	1,45	1,45
EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	USD		2/2/2021	29	2,00		771.738,66		12/29/2020			773.214,66	2,00	5.727.715,14	27,66	4,53	4,53
VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	USD		2/2/2021	29	2,90		221.590,49		7/7/2020			222.205,01	2,90	1.644.850,12	7,94	1,30	1,30
GRUP TOPLAMI							9.830.393,34							20.708.539,65	100,00	16,37	16,38
GRUP TOPLAMI							9.830.393,34							20.708.539,65	100,00	16,37	16,38
DİĞER									5/11/2020								
D.Maden Yabancı																	
XAU0995	USD						13,00	50.155,460769	3/12/2020				60.484,44	5.833.857,21	100,00	4,61	4,62
GRUP TOPLAMI							13,00						60.484,44	5.833.857,21	100,00	4,61	4,62
GRUP TOPLAMI							13,00						60.484,44	5.833.857,21	100,00	4,61	4,62
Döviz																	
USD	USD	FED					41,61	7,473684	12/31/2020				7,42	308,72	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							41,61						7,42	308,72	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							54,61							5.834.165,93	100,00	4,61	4,62
KİRA SERTİFİKALARI																	
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları																	
TRD220921T16	TL	HAZİNE	9/22/2021	261	0,00	2	12.240.000,00	110,117200	12/27/2017	0,45			176,37	21.587.820,71	39,25	17,07	17,09
TRD260122T19	TL	HAZİNE	1/26/2022	387	0,00	2	7.690.000,00	100,150400	11/18/2020	13,72			100,90	7.759.058,36	14,11	6,13	6,14
TRD110522T12	TL	HAZİNE	11/5/2022	492	0,00	2	1.050.000,00	100,827500	11/19/2020	13,06			97,47	1.023.456,19	1,86	0,81	0,81
TRD060722T17	TL	HAZİNE	6/7/2022	548	9,50	2	6.000.000,00	100,000000	8/7/2020	14,64			98,65	5.919.032,92	10,76	4,68	4,69
GRUP TOPLAMI							26.980.000,00						473,39	36.289.368,18	65,98	28,69	28,73
Özel Sektör Kira Sertifikaları																	
TRDZKVK12114	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	6/1/2021	2	0,00	1	3.050.000,00	100,456400	11/13/2020	13,21			103,40	3.153.744,97	5,73	2,49	2,50
TRDBRKT22147	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	12/2/2021	39	3,38	1	1.000.000,00	100,000000	11/27/2020	16,91			101,66	1.016.637,78	1,85	0,80	0,80
TRDZKVK22113	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	12/2/2021	39	0,00	1	1.650.000,00	100,166500	12/25/2020	19,23			101,93	1.681.879,85	3,06	1,33	1,33
TRDBRKT22162	TL	BEREKET VARLIK KIRALAMA A.Ş.	2/23/2021	50	3,76	1	1.500.000,00	100,000000	4/12/2020	18,10			101,42	1.521.355,08	2,77	1,20	1,20
TRDZKVK22139	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	2/24/2021	51	4,00	1	790.000,00	100,000000	12/15/2020	18,18			101,60	802.646,68	1,46	0,63	0,64
TRDZKVK32112	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	11/3/2021	66,00	4,50	1	1.000.000,00	100,000000	4/12/2020	17,88			101,44	1.014.415,45	1,84	0,80	0,80
TRDZKVK32138	TL	ZİRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	3/26/2021	81	0,00	1	300.000,00	100,245200	12/30/2020	19,74			100,49	301.478,02	0,55	0,24	0,24
TRDYVKS2119	TL	PALMET GAZ	12/24/2021	354	0,00	4	6.040.000,00	100,391800	1/22/2020	19,47			101,04	6.103.046,49	11,10	4,82	4,83
TRDYVKS2214	TL	MNG KARGO	12/10/2022	646	9,05	4	3.000.000,00	100,000000	10/14/2020	18,21			103,85	3.115.511,58	5,66	2,46	2,47
GRUP TOPLAMI							18.330.000,00						916,85	18.710.715,90	34,02	14,77	14,81
GRUP TOPLAMI							45.310.000,00						1.390,24	55.000.084,08	100,00	43,46	43,54

FON PORTFÖY DEĞERİ

126.560.286

100,00

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KATILIM DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2020			31 Aralık 2019		
	Tutar	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%	TL	%	%
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	126,560,286		100.17	117,454,444		100.03
B.HAZIR DEĞERLER	264,156		0.21	185,834		-
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	263,848	99.88	0.21	185,587	99.87	-
c) Diğer Hazır Değerler	309	0.12	-	247	0.13	-
C.ALACAKLAR	1,610,432		1.27	-	-	-
a) Takastan Alacaklar Toplamı	1,610,364	100.00	1.27	-	-	-
i) Takastan Alacaklar T1	1,610,364		-	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	-		-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	68		-	-	-	-
i) Diğer Alacaklar	-		-	-	-	-
ii) Temettu	68		-	-	-	-
D. DİĞER VARLIKLAR						
E.BORÇLAR	(2,095,245)		(1.66)	(218,054)		(0.19)
a) Takasa Borçlar	(1,765,576)	84.27	(1.40)	-	-	-
i) Takasa Borçlar T1	(1,765,576)		-	-		-
ii) Takasa Borçlar T2	-		-	-		-
iii) İhbarlı Fon Pay Takas	(207,902)		-	(115,542)		-
b) Yönetim Ücreti	(115,367)	5.51	(0.09)	(96,709)	44.35	-
f) Diğer Borçlar	(2,610)	0.31	-	(2,281)	2.66	-
i) Denetim Reeskontu	(2,255)		-	(2,281)		-
ii) Diğer	(355)		-	-		-
g) Kayda Alma Ücreti	(3,790)	0.18	-	(3,523)	1.62	-
FON TOPLAM DEĞERİ	126,339,629			117,422,224		
Toplam Pay Sayısı	1,000,000,000,000			1,000,000,000,000		
Dolaşımdaki Pay	4,411,229,380			5,640,438,508		
BİRİM PAY DEĞERİ	0.028640			0.020818		