

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 HESAP DÖNEMİNE AİT
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFOY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA
UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR



**VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
HİSSE SENEDİ
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. Hisse Senedi 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. Hisse Senedi 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.
HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTALIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI	1-2
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	3

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
HİSSE SENEDİ 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	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ	HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU														
HİSSE TÜRK															
AKBNK	AKBANK T.A.Ş.					2.790.000	6,145	05/12/19			8,110		22.626.900	8,12	7,84
ARCLK	ARÇELİK A.Ş.					365.064	16,470	23/10/19			20,840		7.607.934	2,73	2,64
ASELS	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.					513.558	23,850	15/11/19			20,940		10.753.905	3,86	3,73
BIMAS	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.					265.906	38,141	24/12/19			46,660		12.407.174	4,46	4,30
EKGYO	EMLAK KONUT GAYR.YAT.ORT.A.Ş.					3.602.686	1,363	19/12/19			1,460		5.259.922	1,89	1,82
ENJSA	ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.					345.274	5,823	30/12/19			7,390		2.551.575	0,92	0,89
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.					2.476.820	8,640	15/11/19			9,040		22.390.453	8,04	7,76
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.					-30.000	8,640	31/12/19			9,040		-271.200	-0,10	-0,09
FROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.					68.558	52,467	22/11/19			70,850		4.857.334	1,74	1,68
GARAN	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.					2.340.000	8,343	05/12/19			11,140		26.067.600	9,37	9,04
HALKB	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.					433.639	5,639	23/10/19			5,910		2.562.806	0,92	0,89
ISCTR	T.İS BANKASI A.Ş.					1.700.000	5,351	05/12/19			6,410		10.897.000	3,91	3,78
ISGYO	İŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.					0	0,000	11/04/19			1,760		0	0,00	0,00
KCHOL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.					385.000	15,958	25/12/19			20,320		7.823.200	2,81	2,71
KCHOL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.					-45.000	15,958	31/12/19			20,320		-914.400	-0,33	-0,32
KOZAL	KOZA ALTIN İŞL.A.Ş.					69.374	43,211	04/12/19			74,050		5.137.145	1,84	1,78
KRDMD	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK					1.743.544	2,793	16/12/19			2,660		4.637.827	1,67	1,61
MIGRS	MİGROS TİC.A.Ş.					209.896	13,602	27/12/19			24,220		5.083.681	1,83	1,76
OTKAR	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA SANAYİ A.Ş.					26.045	109,535	23/10/19			159,000		4.141.155	1,49	1,44
PRTKM	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.					2.869.473	3,687	23/12/19			3,810		10.932.692	3,93	3,79
SAHOL	SABANCI HOLDİNG A.Ş.					1.268.835	8,150	23/12/19			9,540		12.104.686	4,35	4,20
SISE	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.					939.283	5,306	03/12/19			5,270		4.950.021	1,78	1,72
SODA	SODA SANAYİİ A.Ş.					1.038.719	6,736	23/10/19			6,180		6.419.283	2,31	2,22
TAVHL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.					89.503	24,187	30/12/19			29,180		2.611.698	0,94	0,91
TCELL	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.					975.000	12,096	24/12/19			13,800		13.455.000	4,83	4,66
THYAO	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.					1.292.698	13,664	20/12/19			14,460		18.692.413	6,71	6,48

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
HİSSE SENEDİ 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	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Kur	Deger	(%)	(%)
	HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU														
TKFEN	TEKFEN HOLDING A.Ş.				280.253	20,178	02/12/19			19,320		5.414.488	1,94	1,88	
TOASO	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.				214.055	18,871	24/12/19			26,860		5.749.517	2,06	1,99	
TRKCM	TRAKYA CAM SANAYİİ A.Ş.				868.549	2,976	27/12/19			3,500		3.039.922	1,09	1,05	
TTKOM	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.				920.000	4,538	23/12/19			7,370		6.780.400	2,43	2,35	
TUPRS	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.				111.000	123,897	25/12/19			126,800		14.074.800	5,05	4,88	
ULKER	ÜLKER GIDA SAN. VE TİC. A.Ş.				172.559	15,819	01/11/19			22,360		3.858.419	1,39	1,34	
VAKBN	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.				1.594.221	3,763	23/12/19			5,510		8.784.158	3,15	3,04	
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.				3.227.088	2,011	23/10/19			2,480		8.003.178	2,87	2,77	
GRUP TOPLAMI					33.121.600							278.490.686	100,00	96,54	
GRUP TOPLAMI					33.121.600							278.490.686	100,00	96,54	
T. REPO															
TRT110827T16	HAZINE	02/01/20	11,25		7.004.315	11,250	31/12/19		7.462.755	11,380		7.002.132	100,00	2,43	
GRUP TOPLAMI					7.004.315							7.002.132	100,00	2,43	
GRUP TOPLAMI					7.004.315							7.002.132	100,00	2,43	
TPP															
		02/01/20	10,80		471.278,73	10,800000	31/12/19			10,780		471.139,60	100,00	0,16	
GRUP TOPLAMI					471.278,73							471.139,60	100,00	0,16	
GRUP TOPLAMI					471.278,73							471.139,60	100,00	0,16	
VIOP NAKİT TEMİNATI					2.505.179							2.505.178,54	100,00	0,87	
GRUP TOPLAMI					2.505.179							2.505.178,54	100,00	0,87	
GRUP TOPLAMI					2.505.179							2.505.178,54	100,00	0,87	
FON PORTFÖY DEĞERİ												288.469.136	100,00		

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
HİSSE SENEDİ 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 PORTFOY DEĞERİ	288.469.136	-	99,99	259.582.624	-	100,77
B.HAZIR DEĞERLER	656	-	-	2.430	-	0,00
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	656	100,00	-	2.430	100,00	0,00
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	1.183.792	-	0,41	356.061	-	0,14
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	302.100	-	-	-	-	-
c) İleri Valörlü Takas Alacakları	881.692	-	-	-	-	-
d) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	-	-	-	356.061	-	0
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	-1.142.386	-	-0,40	-2.354.426	-	-0,91
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-	-1.341.000	56,96	-0,52
d) Yönetim Ücreti	-480.426	42,05	-0,17	-430.617	18,29	-0,17
e) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
f) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
g) Krediler	-	-	-	-	-	-
h) Diğer Borçlar	-10.894	1,71	0,00	-10.375	0,77	0,00
i) Denetim Ücreti	-2.900	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafları	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	-	-	-	-1.734	-	-
vii) Diğer	-7.994	-	-	-8.641	-	-
j) İhbarlı FonPay Takas	-642.412	-	-	-564.706	-	-
k) Kayda Alma Ücreti	-8.655	0,76	-	-7.727	0,33	0,00
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	288.511.198		100,00	257.586.688		100,00