

AEGON EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
HİSSE SENEDİ 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

**AEGON 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**

Aegon 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 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 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Aegon 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 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 Aegon 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, 16 Mart 2020

**AEGON EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM
FONU**

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

AEGON 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	Nominal	Faiz	Faiz	Nominal	Birim	Satın	Borsa	Repo	Günlük	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oran	Sayı	Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Tarihi	Sözleşme Numarası	Teminat Tutar	Birim Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ	ANADOLU EFES BİRACILIK	-	AEFES	-	-	20.000,00	26,069051	25.10.2018	80100518995785140	-	23,0800	-	461.600,00	2,51	2,31
	AKBANK T.A.S.	-	AKBNK	-	-	230.000,00	6,773227	9.07.2019	801005112314251170	-	8,1100	-	1.865.300,00	10,13	9,35
	ARCELİK	-	ARCLK	-	-	15.000,00	17,363991	8.11.2019	801005113904806190	-	20,8400	-	312.600,00	1,70	1,57
	ASELSAN ELEKTRONİK	-	ASELS	-	-	10.000,00	22,071666	11.11.2019	801005113935996790	-	20,9400	-	209.400,00	1,14	1,05
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	12.000,00	28,100940	26.07.2019	80100519231976620	-	46,6600	-	559.920,00	3,04	2,81
	COCA COLA	-	CCOLA	-	-	4.000,00	35,618750	10.05.2018	80100516935313770	-	38,7000	-	154.800,00	0,84	0,78
	EKGYO	-	EKGYO	-	-	100.000,00	2,510000	9.05.2018	80100516923494420	-	1,4600	-	146.000,00	0,79	0,73
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.	-	ENJSA	-	-	80.000,00	6,782941	15.08.2018	80100518123300480	-	7,3900	-	591.200,00	3,21	2,96
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK	-	EREGL	-	-	140.000,00	7,380915	5.12.2019	801005114413414530	-	9,0400	-	1.265.600,00	6,87	6,34
	FORD OTOMOTİV SANAYİ	-	FROTO	-	-	5.096,00	57,731750	25.07.2018	80100517838783650	-	70,8500	-	361.051,60	1,96	1,81
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	GARAN	-	-	170.000,00	8,538387	9.07.2019	801005112313560470	-	11,1400	-	1.893.800,00	10,27	9,48
	HALK BANKASI	-	HALKB	-	-	75.000,00	6,903333	25.10.2018	80100518990720170	-	5,9100	-	443.250,00	2,41	2,22
	T.İS BANKASI A.Ş.	-	ISCTR	-	-	120.000,00	6,329772	27.12.2018	80100517187453810	-	6,4100	-	769.200,00	4,18	3,86
	KOC HOLDING	-	KCHOL	-	-	40.000,00	13,210146	3.12.2019	801005114355250620	-	20,3200	-	812.800,00	4,41	4,07
	KARDEMİR KARABÜK	-	KRDMD	-	-	125.000,00	4,489986	27.12.2018	80100517838758510	-	2,6600	-	332.500,00	1,81	1,67
	MGROS	-	MGROS	-	-	10.418,00	25,639068	17.05.2018	80100517020646170	-	24,2200	-	252.323,96	1,37	1,26
	PETKİM PETROKİMYA	-	PETKM	-	-	140.800,00	4,458300	21.06.2019	80100516894012240	-	3,8100	-	536.448,00	2,91	2,69
	SABANCI	-	SAHOL	-	-	75.000,00	9,569750	27.12.2018	80100517470105470	-	9,5400	-	715.500,00	3,89	3,59
	SELCUK ECZA DEPOSU	-	SELEC	-	-	35.000,00	3,177907	27.03.2018	80100516422016360	-	6,1000	-	213.500,00	1,16	1,07
	SODA SANAYİ	-	SODA	-	-	30.000,00	6,880000	11.02.2019	801005110429177680	-	6,1800	-	185.400,00	1,01	0,93
	TAT GIDA SANAYİ A.Ş.	-	TATGD	-	-	40.000,00	5,890000	25.10.2018	80100518993354600	-	6,2900	-	251.600,00	1,37	1,26
	TURKCELL İLETİSİM	-	TCELL	-	-	80.000,00	11,914659	21.03.2019	801005111022048420	-	13,8000	-	1.104.000,00	5,99	5,53
	TURK HAVA YOLLARI	-	THYAO	-	-	60.000,00	10,845795	8.04.2019	801005111291683750	-	14,4600	-	867.600,00	4,71	4,35
	TOFAS	-	TOASO	-	-	10.000,00	23,980000	8.11.2019	801005113904916010	-	26,8600	-	268.600,00	1,46	1,35
	TRAKYA ÇAM	-	TRKCM	-	-	55.310,00	3,454547	27.12.2018	80100517259597260	-	3,5000	-	193.585,00	1,05	0,97
	T.SINAI KALK. BANKASI A.Ş.	-	TSKB	-	-	300.000,00	0,790000	5.07.2019	801005112262767060	-	1,2100	-	363.000,00	1,97	1,82
	TTKOM	-	TTKOM	-	-	40.000,00	6,157846	28.06.2018	80100517465526870	-	7,3700	-	294.800,00	1,60	1,48
	TUPRAS	-	TUPRS	-	-	9.000,00	91,495216	21.03.2019	801005111023117770	-	126,8000	-	1.141.200,00	6,20	5,72
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	-	VAKBN	-	-	125.000,00	4,468530	27.12.2018	80100518569748840	-	5,5100	-	688.750,00	3,74	3,45
	YATAS YATAK	-	YATAS	-	-	50.000,00	4,050000	30.11.2018	80100519468610120	-	7,3400	-	367.000,00	1,99	1,84
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	-	YKBKN	-	-	320.000,00	2,602226	9.07.2019	801005112314032760	-	2,4800	-	793.600,00	4,31	3,98
GRUP TOPLAMI						2.526.624,00							18.415.928,56	100,00	92,30
GRUP TOPLAMI						2.526.624,00							18.415.928,56	100,00	92,30

AEGON 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 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	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
BORÇLANMA SENETLERİ															
DEVLET TAHVİLİ	HAZINE	15.01.2020	TRT150120T16	12,68	-	900.000,00	101,823100	20.11.2019	10,58	-	104,8449	-	943.603,90	100,00	4,73
GRUP TOPLAMI						900.000,00							943.603,90	100,00	4,73
GRUP TOPLAMI						900.000,00							943.603,90	100,00	4,73
TPP															
TPP	-	2.01.2020	-	11,00	-	592.356,82	11,000000	31.12.2019	-	592.356,82	10,7800	-	592.181,95	100,00	2,97
						592.356,82							592.181,95	100,00	2,97
						592.356,82							592.181,95	100,00	2,97
FON PORTFÖY DEĞERİ													19.951.714		100,00

AEGON 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 PORTFÖY DEĞERİ	19.951.714	-	100,26	18.483.522	100,00	100,45
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ						
B,HAZIR DEĞERLER	231,30	-	-	811,65	100,00	0,004
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	231,30	100,00	-	811,65	100,00	0,004
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C,ALACAKLAR	2.617,14	-	0,01	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	2.617,14	-	0,01	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(55.353,86)	-	(0,28)	(83.821,67)	100,00	(0,46)
a) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
b) İhbarlı Fon Pay Takas	(189,04)	-	-	(30.052,00)	35,85	(0,16)
c) Yönetim Ücreti	(32.518,90)	58,75	(0,16)	(31.540,00)	37,63	(0,17)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(22.049,02)	40,91	(0,11)	(22.229,67)	26,52	(0,12)
i) Denetim Ücreti	(13.210,97)	-	(0,07)	(13.534,00)	60,88	(0,07)
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Diğer	(8.838,05)	-	(0,04)	(8.695,67)	39,12	(0,05)
ı) Kayda Alma Ücreti	(596,90)	1,08	-	-	-	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	19.899.209			18.400.512		