

AEGON HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATKI 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. KATKI 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. Katkı 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. Katkı 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 HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER

SAYFA

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

AEGON HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	İtfa 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 (%)
A.HİSSE SENEDİ															
HİSSE SENETLERİ															
	AKBNK	-	AKBNK	-	-	15.000	7,54	24/07/2019	-	-	8,11	1	121.650	5,58	0,69
	ARCLK	-	ARCLK	-	-	8.000	18,43	31/07/2019	-	-	20,84	1	166.720	7,64	0,95
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	2.000	46,48	31/07/2019	-	-	46,66	1	93.320	4,28	0,53
	CEMTS	-	CEMTS	-	-	20.000	5,32	06/08/2019	-	-	8,28	1	165.600	7,59	0,94
	EREGL	-	EREGL	-	-	15.000	7,28	31/07/2019	-	-	9,04	1	135.600	6,22	0,77
	GARAN	-	GARAN	-	-	15.000	9,81	30/07/2019	-	-	11,14	1	167.100	7,66	0,95
	ISCTR	-	ISCTR	-	-	20.000	6,41	26/07/2019	-	-	6,41	1	128.200	5,88	0,73
	KRDMA	-	KRDMA	-	-	30.000	2,07	23/09/2019	-	-	2,65	1	79.500	3,65	0,45
	KRDMD	-	KRDMD	-	-	60.000	2,16	31/07/2019	-	-	2,66	1	159.600	7,32	0,91
	PETKM	-	PETKM	-	-	30.000	3,99	01/08/2019	-	-	3,81	1	114.300	5,24	0,65
	SISE	-	SISE	-	-	15.000	4,86	23/07/2019	-	-	5,27	1	79.050	3,62	0,45
	SODA	-	SODA	-	-	26.000	6,09	20/11/2019	-	-	6,18	1	160.680	7,37	0,91
	TCELL	-	TCELL	-	-	10.000	13,14	31/07/2019	-	-	13,8	1	138.000	6,33	0,78
	THYAO	-	THYAO	-	-	10.000	12,66	24/07/2019	-	-	14,46	1	144.600	6,63	0,82
	TSKB	-	TSKB	-	-	75.000	0,84	01/08/2019	-	-	1,21	1	90.750	4,16	0,52
	TTKOM	-	TTKOM	-	-	20.000	5,47	31/07/2019	-	-	7,37	1	147.400	6,76	0,84
	TUPRS	-	TUPRS	-	-	700	129,7	23/07/2019	-	-	126,8	1	88.760	4,07	0,50
ARA GRUP TOPLAMI						371.700									12,39
GRUP TOPLAMI						371.700							2.180.830		12,39

AEGON HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	İtfa 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
B.BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili	T.C.	12/08/2020	TRT120820T12	11,50	4	350.000	107,447	15/03/2019	-	-	116,115370	1	406.403,80	2,71	2,31
Devlet Tahvili	T.C.	22/09/2021	TRT220921T18	4,60	2	500.000	85,090	21/09/2018	3,0700	-	99,279880	1	496.399,40	3,31	2,82
Devlet Tahvili	T.C.	02/03/2022	TRT020322T17	5,50	2	1.500.000	100,204	08/02/2018	1,1600	-	102,897210	1	1.543.458,15	10,29	8,77
Devlet Tahvili	T.C.	17/08/2022	TRT170822T15	5,35	2	250.000	99,242	08/02/2018	1,1200	-	102,311180	1	255.777,95	1,71	1,45
Devlet Tahvili	T.C.	18/01/2023	TRT180123T10	6,10	2	500.000	100,015	04/04/2018	-	-	107,637520	1	538.187,60	3,59	3,06
Devlet Tahvili	T.C.	08/03/2023	TRT080323T10	3,55	2	150.000	77,963	06/03/2019	4,3000	-	90,552930	1	135.829,40	0,91	0,77
Devlet Tahvili	T.C.	14/06/2023	TRT140623T19	8,10	2	1.200.000	86,331	09/10/2018	0,0000	-	114,206600	1	1.370.479,20	9,14	7,78
Devlet Tahvili	T.C.	27/09/2023	TRT270923T11	4,40	2	30.000	89,675	08/02/2018	2,7600	-	94,280830	1	28.284,25	0,19	0,16
Devlet Tahvili	T.C.	27/09/2023	TRT270923T11	4,40	2	500.000	72,313	17/12/2018	2,7600	-	94,280830	1	471.404,15	3,14	2,68
Devlet Tahvili	T.C.	24/07/2024	TRT240724T15	4,50	2	900.000	87,905	08/02/2018	2,3600	-	93,936710	1	845.430,39	5,64	4,80
Devlet Tahvili	T.C.	24/07/2024	TRT240724T15	4,50	2	1.100.000	86,224	02/12/2019	2,3600	-	93,936710	1	1.033.303,81	6,89	5,87
Devlet Tahvili	T.C.	12/03/2025	TRT120325T12	4,00	2	663.000	85,357	08/02/2018	3,2800	-	87,944600	1	583.072,70	3,89	3,31
Devlet Tahvili	T.C.	11/02/2026	TRT110226T13	5,30	2	3.000.000	81,249	02/12/2019	1,3400	-	97,948310	1	2.938.449,30	19,60	16,69
Devlet Tahvili	T.C.	24/02/2027	TRT240227T17	5,50	2	1.000.000	100,270	08/02/2018	0,9000	-	98,944610	1	989.446,10	6,60	5,62
Devlet Tahvili	T.C.	11/08/2027	TRT110827T16	5,25	2	2.700.000	79,034	02/09/2019	0,5700	-	96,738800	1	2.611.947,60	17,42	14,83
Devlet Tahvili	T.C.	08/03/2028	TRT080328T15	6,20	2	600.000	81,006	09/11/2018	0,0500	-	105,806750	1	634.840,50	4,23	3,61
Varlığa Dayalı MK	Türkiye Kalkınma ve Yatırım Bankası A.Ş. Varlık Finansmanı Fonu	07/12/2023	TRPKYVFA2318	4,25	4	100.000	100,000	07/12/2018	-	-	110,579980	1	110.579,98	0,74	0,63
ARA GRUP TOPLAMI						15.043.000							14.993.294,28		85,15
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	T. İş Bankası A.Ş.	13/09/2029	TRTISB92918	4,31	12	100.000	100,000	26/09/2019	0,3300	-	99,770520	1	99.770,52		0,57
	Yapı ve Kredi Bank A.Ş.	20/06/2029	TRSYKBK62914	4,11	4	100.000	100,000	03/07/2019	0,2300	-	104,110130	1	104.110,13		0,59
ARA GRUP TOPLAMI						200.000							203.880,65		1,16
GRUP TOPLAMI						15.243.000							15.197.174,93		86,31
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
H.VADELİ MEVDUAT	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
L.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BPP		02/01/2020	-	11,00	-	230.139	100.000	31/12/2019	11,6200	-	100.030	1	230.069	10.000,00	131,00
ARA GRUP TOPLAMI						230.139							230.069		131,00
GRUP TOPLAMI						230.139							230.069		131,00
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						15.844.839							17.608.074		

AEGON HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI 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	17.608.074,22	-	99,960	15.106.691,00	100,00	99,947
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	17.608.074,31	-	99,960			-
B,HAZIR DEĞERLER	2.837,10	-	0,020	1.920,95	100,00	0,013
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	2.837,10	100,00	0,020	1.920,95	100,00	0,013
C,ALACAKLAR	21.505,65		0,120	18.520,05	100,00	0,013
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	21.505,65	100,00	0,120	18.520,05	100,00	0,013
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(18.071,29)	-	(0,100)	(12.399,81)	100,00	(0,082)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(4.038,74)	22,35	(0,020)	3.418,00	100,00	0,023
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(14.032,55)	77,65	(0,080)	(8.981,81)	72,44	(0,059)
i) Denetim Ücreti	(8.201,12)	45,38	(0,050)	(7.631,00)	84,96	(0,050)
ii) İlan Giderleri	-	-	-	(551,81)	6,15	(0,004)
iii) Noter Masrafı	-	-	-	(799,00)	8,90	(0,005)
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Diğer	(5.831,43)	32,27	(0,030)	-	-	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0,00	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	17.614.346			15.114.732		