

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ KATILIM 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 KATILIM 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 Katılım 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 Katılım 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 KATILIM DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

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

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ KATILIM 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	Nominal Tutarı	Faiz Oranı	Faiz Ödemesi	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 (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
ALCTL	ALCATEL LUCENT TELETAS TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	-	-	-	3.250,00	9,98	21/11/19	-	-	12,04	-	39.130,00	1,85	0,60
ALKIM	ALKIM ALKALİ KİMYA A.Ş.	-	-	-	-	2.500,00	25,22	31/12/19	-	-	38,32	-	95.800,00	4,54	1,47
ALKIM	ALKIM ALKALİ KİMYA A.Ş.	-	-	-	-	(200,00)	25,22	30/12/19	-	-	38,32	-	(7.664,00)	(0,36)	(0,12)
AELS	AELSAN ELEKTRONİK SAN. VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	9.750,00	22,35	09/12/19	-	-	20,94	-	204.165,00	9,68	3,14
BANVT	BANVİT BANDIRMANLI VİTAMİNLİ YEM SAN.A.Ş.	-	-	-	-	2.250,00	15,20	29/11/19	-	-	18,57	-	41.782,50	1,98	0,64
BİMAS	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	-	-	-	3.950,00	42,34	11/12/19	-	-	46,66	-	184.307,00	8,74	2,83
CEMTS	ÇEMTAŞ ÇELİK MAKİNA SAN VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	8.000,00	5,64	31/12/19	-	-	8,28	-	66.240,00	3,14	1,02
CEMTS	ÇEMTAŞ ÇELİK MAKİNA SAN VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	(2.000,00)	5,64	30/12/19	-	-	8,28	-	(16.560,00)	(0,78)	(0,25)
ECİLC	ECZACIBAŞI İLAÇ SİNAİ VE FİNANSAL YATIRIMLAR	-	-	-	-	16.000,00	3,53	27/11/19	-	-	3,71	-	59.360,00	2,81	0,91
EĞEEN	EĞE ENDÜSTRİ VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	180,00	436,85	31/12/19	-	-	580,50	-	104.490,00	4,95	1,61
EĞEEN	EĞE ENDÜSTRİ VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	(20,00)	436,85	30/12/19	-	-	580,50	-	(11.610,00)	(0,55)	(0,18)
EGSER	EĞE SERAMİK SANAYİ VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	7.000,00	3,20	31/12/19	-	-	3,71	-	25.970,00	1,23	0,40
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	-	-	-	24.000,00	8,38	31/12/19	-	-	9,04	-	216.960,00	10,28	3,33
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	-	-	-	(1.000,00)	8,38	30/12/19	-	-	9,04	-	(9.040,00)	(0,43)	(0,14)
FROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	3.100,00	56,15	26/08/19	-	-	70,85	-	219.635,00	10,41	3,38
FROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	(100,00)	56,15	30/12/19	-	-	70,85	-	(7.085,00)	(0,34)	(0,11)
GENTS	GENTAŞ GENEL METAL SANAYİ VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	18.000,00	1,43	03/10/19	-	-	2,19	-	39.420,00	1,87	0,61
HLGYO	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	-	-	-	-	21.000,00	1,01	31/12/19	-	-	1,22	-	25.620,00	1,21	0,39
İSDMR	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	-	-	-	13.500,00	6,48	31/12/19	-	-	8,01	-	108.135,00	5,13	1,66
İSDMR	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	-	-	-	(1.000,00)	6,48	30/12/19	-	-	8,01	-	(8.010,00)	(0,38)	(0,12)
KERVİT	KEREVİTAŞ GIDA SANAYİ VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	12.000,00	2,51	22/11/19	-	-	3,26	-	39.120,00	1,85	0,60
KFEIN	KAFEİN YAZILIM TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	4.000,00	8,08	11/12/19	-	-	11,14	-	44.560,00	2,11	0,68
KNFRT	KONFRUT GIDA SANAYİ VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	2.650,00	7,74	15/11/19	-	-	7,82	-	20.723,00	0,98	0,32
KUTPO	KÜTAHYA PORSELEN SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	3.500,00	4,18	03/10/19	-	-	6,62	-	23.170,00	1,10	0,36
LOGO	LOGO YAZILIM SANAYİ VE TİC.A.Ş.	-	-	-	-	1.650,00	38,12	31/12/19	-	-	60,80	-	100.320,00	4,76	1,54
MAVİ	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	3.600,00	37,45	31/12/19	-	-	57,90	-	208.440,00	9,88	3,20
ORGE	ORGE ELEKTRİK ENERJİ TAHHÜT A.Ş.	-	-	-	-	6.750,00	3,66	11/12/19	-	-	4,96	-	33.480,00	1,59	0,52
PETUN	PİNAR ENTEGRE ET VE UN SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	4.000,00	6,26	04/12/19	-	-	9,17	-	36.680,00	1,74	0,56
SELEC	SELÇUK ECZA DEPOSU TİC.VE SAN.A.Ş.	-	-	-	-	16.000,00	4,20	31/12/19	-	-	6,10	-	97.600,00	4,63	1,50
SELEC	SELÇUK ECZA DEPOSU TİC.VE SAN.A.Ş.	-	-	-	-	(1.000,00)	4,20	30/12/19	-	-	6,10	-	(6.100,00)	(0,29)	(0,09)
TATGD	TAT GIDA SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	6.600,00	4,09	20/06/19	-	-	6,29	-	41.514,00	1,97	0,64
YATAS	YATAŞ YATAK VE YORGAN SAN.TİC.A.Ş.	-	-	-	-	16.000,00	6,38	31/12/19	-	-	7,34	-	117.440,00	5,57	1,80
YATAS	YATAŞ YATAK VE YORGAN SAN.TİC.A.Ş.	-	-	-	-	(2.500,00)	6,38	30/12/19	-	-	7,34	-	(18.350,00)	(0,87)	(0,28)
GRUP TOPLAMI						201.410,00							2.109.642,50	100,00	32,42
GRUP TOPLAMI						201.410,00							2.109.642,50	100,00	32,42

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ KATILIM 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 (%)
KATILIM HESABI															
KATILIM HESABI															
ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.		06/01/20	-	11,80	-	217.768,60	-	22/11/19	-	-	11,80	-	220.584,68	37,62	3,39
TÜRKİYE EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.		06/01/20	-	11,50	-	287.125,83	-	03/12/19	-	-	11,50	-	289.749,29	49,41	4,45
ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.		16/03/20	-	12,05	-	75.000,00	-	20/11/19	-	-	12,05	-	76.039,93	12,97	1,17
GRUP TOPLAMI						579.894,43							586.373,90	100,00	9,01
GRUP TOPLAMI						579.894,43							586.373,90	100,00	9,01
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
TRD120220T16	HAZINE	12/02/20	-	0,00	-	390.000,00	103,24	25/12/19	9,45	-	105,26	-	410.514,20	10,77	6,31
TRD230920T24	HAZINE	23/09/20	-	0,00	-	290.000,00	107,16	15/10/19	10,18	-	116,48	-	337.791,75	8,86	5,19
TRD100221T17	HAZINE	10/02/21	-	17,60	-	60.000,00	100,00	09/07/19	10,97	-	113,85	-	68.312,08	1,79	1,05
TRD220921T16	HAZINE	22/09/21	-	0,00	-	10.000,00	155,84	26/12/19	1,81	-	156,42	-	15.642,07	0,41	0,24
TRD100822T10	HAZINE	10/08/22	-	0,00	-	30.000,00	85,08	30/09/19	10,02	-	106,39	-	31.916,05	0,84	0,49
GRUP TOPLAMI						780.000,00							864.176,15	22,67	13,28
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDHVKA12022	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	07/01/20	-	4,57	-	550.000,00	100,00	17/09/19	15,68	-	104,32	-	573.770,20	15,06	8,82
TRDHVKA12014	EMLAK KONUT GAYR.YAT.ORT.A.Ş.	28/01/20	-	0,00	-	280.000,00	100,13	21/08/19	18,98	-	107,48	-	300.942,54	7,90	4,63
TRDZVKV32013	ZİRAAT KATILIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	11/03/20	-	2,96	-	850.000,00	100,00	06/12/19	9,97	-	101,10	-	859.338,06	22,55	13,21
TRDHVKA42011	EMLAK KONUT GAYR.YAT.ORT.A.Ş.	07/04/20	-	4,64	-	350.000,00	100,00	19/11/19	12,53	-	101,41	-	354.932,08	9,31	5,45
TRDHVKA52010	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	12/05/20	-	4,39	-	150.000,00	100,00	17/12/19	11,26	-	100,44	-	150.659,03	3,95	2,32
TRDHVKA52028	KAYSERİ ŞEKER FABRİKASI A.Ş.	14/05/20	-	4,51	-	100.000,00	100,00	26/12/19	12,18	-	100,19	-	100.189,11	2,63	1,54
TRDHVKA62019	EMLAK KONUT GAYR.YAT.ORT.A.Ş.	09/06/20	-	4,92	-	200.000,00	100,00	24/12/19	11,01	-	100,23	-	200.458,38	5,26	3,08
TRDKTLM22014	KATILIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12/02/20	-	0,00	-	300.000,00	101,77	31/12/19	14,27	-	101,82	-	305.463,64	8,02	4,69
TRDKTLM52011	KATILIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	27/05/20	-	18,40	-	100.000,00	100,00	28/05/18	14,54	-	101,15	-	101.153,64	2,65	1,55
GRUP TOPLAMI						2.880.000,00							2.946.906,68	77,33	45,29
GRUP TOPLAMI						3.660.000,00							3.811.082,83	100,00	58,57
FON PORTFÖY DEĞERİ													6.507.099,23		100,00

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.**OKS DENGELİ KATILIM 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	6.507.099	-	99,78	3.058.958	-	92,79
B,HAZIR DEĞERLER	8.131		0,12	25.393	-	0,77
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	8.131	100,00	0,12	25.393	100,00	0,77
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C,ALACAKLAR	83.764	-	1,28	226.313	-	6,86
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	83.764	-	-	207.607	-	0,00
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-	12.055	-	0,00
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	6.652	-	0,00
E,BORÇLAR	(77.812)	-	(1,19)	(13.882)	-	(0,42)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(4.236)	5,44	(0,06)	(2.159)	15,55	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) İhbarlı Fon Pay Takas	(31.147)	-	-	(7.379)	-	-
h) Diğer Borçlar	(42.233)	54,53	(0,65)	(4.245)	31,29	(0,13)
i) Denetim Ücreti	-	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	(605)	-	(0,01)	(943)	-	(0,03)
vii) Diğer	(41.628)	-	(0,64)	(3.302)	-	(0,10)
i) Kayda Alma Ücreti	(196)	0,25	-	(99)	-	(0,23)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	6.521.183	-	100,00	3.296.782	-	100,00