

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş
PERA 3 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHİ İTİBARIYLA
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.
PERA 3 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**

Vakıf Emeklilik ve Hayat A.Ş. Pera 3 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 ilişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'na ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2018 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Vakıf Emeklilik ve Hayat A.Ş. Pera 3 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 ilişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'na 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, 29 Nisan 2019

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş
PERA 3 DEĞİŞKEN GRUP 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.
PERA 3 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük						
Kıymet	Kurum	Tarihi	Menkul	Faiz	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam		
			Tanımı	Oranı	Sayı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)		
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
AKBNK	AKBANK	-	-	-	-	50,000	8.746	5/30/2018	-	-	6.860	-	343,000	9.96	2.10	
AKGRT	AKGRT	-	-	-	-	35,000	3.727	6/29/2018	-	-	3.660	-	128,100	3.72	0.79	
ARCLK	ARÇELİK A.Ş.	-	-	-	-	10,050	19.893	6/12/2018	-	-	15.790	-	158,690	4.61	0.97	
ASELS	ASELS	-	-	-	-	10,000	25.587	8/15/2018	-	-	24.080	-	240,800	6.99	1.48	
ENJSA	ENERJISA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	-	-	-	-	18,000	6.535	6/29/2018	-	-	5.100	-	91,800	2.67	0.56	
EREGL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	-	-	-	37,000	9.702	12/5/2018	-	-	7.220	-	267,140	7.76	1.64	
FROTO	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	-	-	-	2,000	54.000	12/5/2018	-	-	50.000	-	100,000	2.90	0.61	
GARAN	T.GARANTİ BANKASI A.S.	-	-	-	-	54,250	10.617	2/13/2018	-	-	7.960	-	431,830	12.53	2.65	
HEKTS	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.	-	-	-	-	12,500	7.335	5/11/2018	-	-	9.270	-	115,875	3.37	0.71	
KCHOL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	-	-	-	-	8,000	15.160	8/15/2018	-	-	14.200	-	113,600	3.30	0.70	
KOZAL	KOZA ALTIN İŞL.A.Ş.	-	-	-	-	3,750	36.216	10/22/2018	-	-	51.300	-	192,375	5.59	1.18	
PETKM	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.	-	-	-	-	20,000	4.340	8/6/2018	-	-	5.040	-	100,800	2.93	0.62	
PGSUS	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	-	-	-	2,100	27.313	8/6/2018	-	-	22.920	-	48,132	1.40	0.30	
SODA	SODA SANAYİİ A.Ş.	-	-	-	-	20,000	6.106	8/6/2018	-	-	7.100	-	142,000	4.12	0.87	
TCELL	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.	-	-	-	-	25,000	14.452	12/5/2018	-	-	12.170	-	304,250	8.84	1.87	
THYAO	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	-	-	-	14,000	15.023	8/6/2018	-	-	16.110	-	225,540	6.55	1.38	
TKFEN	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	-	-	-	8,000	15.549	6/29/2018	-	-	20.720	-	165,760	4.81	1.02	
TRKCM	TRKCM	-	-	-	-	354	4.001	12/5/2018	-	-	3.030	-	1,073	0.03	0.01	
TTKOM	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	-	-	-	40,000	3.950	12/5/2018	-	-	3.900	-	156,000	4.53	0.96	
TUPRS	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFINERİ A.Ş.	-	-	-	-	1,000	128.633	6/29/2018	-	-	116.700	-	116,700	3.39	0.72	
GRUP TOPLAMI						371,004						3,443,464	100.00	21.14		
BORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvili																
TRT150519T15	HAZINE	5/15/2019	-	13.36	-	1,700,000	100.272	11/17/2017	22.60	-	97.942	-	1,665,008	15.31	10.21	
TRT131119T19	HAZINE	11/13/2019	-	0.00	-	4,000,000	94.803	7/11/2018	21.21	-	96.217	-	3,848,668	35.41	23.60	
TRT020322T17	HAZINE	3/2/2022	-	12.52	-	1,500,000	96.934	11/9/2017	18.43	-	87.952	-	1,319,276	12.13	8.09	
TRT180123T10	HAZINE	1/18/2023	-	12.57	-	700,000	100.225	3/12/2018	18.11	-	90.870	-	636,093	5.85	3.90	
GRUP TOPLAMI						7,900,000						7,469,045	68.70	45.80		

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş

PERA 3 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük				
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
Özel Sektör															
Finansman Bonosu															
TRFHEKT31916	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.	3/12/2019	-	25.20	-	40,000	94.70	12/21/2018	27.79	-	95.406	-	38,163	0.35	0.23
GRUP TOPLAMI						40,000							38,163	0.35	0.23
Özel Sektör Tahvil															
TRSNLOG21912	NETLOG LOJİSTİK HİZMETLERİ A.Ş.	2/13/2019	-	15.76	-	180,000	100.26	10/11/2017	27.23	-	103.157	-	185,683	1.71	1.14
TRSODAS21911	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN.TİC.A.Ş.	2/25/2019	-	15.57	-	120,000	100.00	10/12/2017	32.56	-	101.657	-	121,989	1.12	0.75
TRSDOGH72112	DOĞUŞ HOLDİNG A.Ş	7/26/2021	-	16.77	-	710,000	100.00	10/20/2017	42.76	-	96.555	-	685,541	6.31	4.20
TRSENSA72211	ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	7/26/2022	-	5.00	-	640,000	100.00	8/1/2017	5.80	-	129.016	-	825,703	7.59	5.06
TRSTISB72712	T.IS BANKASI	7/27/2027	-	13.91	-	1,300,000	100.00	8/8/2017	23.97	-	103.390	-	1,344,064	12.36	8.24
GRUP TOPLAMI						2,950,000							3,162,980	29.09	19.39
GRUP TOPLAMI						10,890,000							10,670,188	98.14	65.42
MEVDUAT															
YAPI KREDİ BANK	-	2/4/2019	-	23.50	-	900,000	-	12/17/2018	-	-	23.500	-	908,598	100.00	5.57
GRUP TOPLAMI						900,000							908,598	100.00	5.57
GRUP TOPLAMI						900,000							908,598	100.00	5.57
TPP															
TPP	-	1/2/2019	-	23.80	-	456,595	23.80	12/31/2018	-	-	24.360	-	456,290	94.02	2.80
TPP	-	1/2/2019	-	23.80	-	29,038	23.80	12/31/2018	-	-	24.360	-	29,018	5.98	0.18
GRUP TOPLAMI						900,000							908,598	100.00	2.98
DİĞER															
Y.Fonu Yabancı															
EEM	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	-	-	-	-	2,000	42.06	12/5/2018	-	-	39.240	-	414,453	69.67	2.54
VOO	VANGUARD GROUP	-	-	-	-	150	257.25	12/5/2018	-	-	227.760	-	180,420	30.33	1.11
GRUP TOPLAMI						2,150							594,873	100.00	3.65
Döviz															
USD	ABD HAZİNE	-	-	-	-	28,075	5.51	12/31/2018	-	-	5.281	-	148,263	0.00	0.00
GRUP TOPLAMI						28,075							148,263	0.00	0.00
KİRA SERTİFİKALARI															
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
TRDKTSK31915	KT SUKUK VARLIK KİRALAMA A.Ş.	3/26/2019	-	6.91	-	200,000	100.00	12/13/2018	26.70	-	101.240	-	202,479	1.86	1.24
GRUP TOPLAMI						200,000							202,479	1.86	1.24
GRUP TOPLAMI						200,000							202,479	1.86	1.24
FON PORTFÖY TOPLAMI													16,304,911		100.00

VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş
PERA 3 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2018			31 Aralık 2017		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	16,304,911	-	98.86	17,148,153	-	100.07
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	16,304,911	-	98.86	17,148,153	-	100.07
B.HAZIR DEĞERLER	151,419	-	0.92	1,406	-	0.01
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	3,156	2.08	0.02	1,406	100	0.01
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	148,263	97.92	0.90	-	-	-
C.ALACAKLAR	72,918	-	0.44	-	-	1.99
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	72,918	-	0.44	-	100	1.99
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	(36,600)	-	(0.22)	(12,766)	-	(2.06)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(9,756)	26.66	(0.06)	(10,726)	3.04	(0.06)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(5,022)	15.07	(0.03)	(1,028)	96.64	(1.99)
i) Denetim Ücreti	-	-	-	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Denetim Reeskontu	(944)	-	(0.01)	-	-	-
vii) Diğer	(4,078)	-	(0.02)	-	-	-
h) İhbarlı Fon Pay Takas	(21,328)	-	0.00	(498)	0.14	0.00
i) Kayda Alma Ücreti	(495)	1.35	0.00	(514)	0.15	0.00
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-	-	-	-
Fon toplam değeri	16,492,648		100.00	17,136,793		100.01