TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. VEM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU (ESKİ UNVANIYLA VAKIF EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU)

Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Denetim Raporu

Güney Bağımsız Denetim ve SMMM A.Ş.
Maslak Mah. Eski Büyükdere Cad.
Orjin Maslak İş Merkezi No: 27
Kat: 2-3-4 Daire: 54-57-59
34485 Sarıyer
İstanbul - Türkiye

Tel: +90 212 315 3000
Fax: +90 212 230 8291
ey.com
Ticaret Sicil No : 479920
Mersis No: 0-4350-3032-6000017

Building a better working world

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Vem Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun (Eski Unvanıyla Vakıf Emeklilik Ve Hayat A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu) Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Vem Standart Emeklilik Yatırım Fonu (Eski Unvanıyla Vakıf Emeklilik Ve Hayat A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu) Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin 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 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Vem Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun (Eski Unvanıyla Vakıf Emeklilik Ve Hayat A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu) pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Vem Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun (Eski Unvanıyla Vakıf Emeklilik Ve Hayat A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu) bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik Anonim Şirketi
A member firm of Ernst&Young Global Limited

Fatih Polat, SMMM
Sorumlu Denetçi

29 Nisan 2021
İstanbul, Türkiye

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. VEM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası (''TL'') olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ																	
Hisse Türk																	
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.					100,00	6,295300	26/11/20					6,930000	693,00	0,00	0,00
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.					100,00	17,161500	27/11/20					30,400000	3.040,00	0,02	0,00
ASELS	TL	ASELSAN ELEKT.SAN. VE TİC. A.Ş.					100,00	11,054700	26/11/20					18,250000	1.825,00	0,01	0,00
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞ. A.Ş.					100,00	47,973600	27/11/20					75,500000	7.550,00	0,04	0,00
DOHOL	TL	DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU HOLD.A.Ş.					100,00	3,060000	14/12/20					3,070000	307,00	0,00	0,00
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYR.YAT.ORT.A.Ş.					100,00	1,216400	26/11/20					2,140000	214,00	0,00	0,00
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.					100,00	7,623100	27/11/20					14,930000	1.493,00	0,01	0,00
GARAN	TL	T.GARANTİ BANKASI A.S.					100,00	8,375000	26/11/20					10,370000	1.037,00	0,01	0,00
GUBRF	TL	GÜBRE FABR. T.A.Ş.					15,00	35,940000	09/10/20					86,050000	1.290,75	0,01	0,00
HALKB	TL	HALK BANKASI A.Ş.					100,00	6,096400	27/11/20					5,560000	556,00	0,00	0,00
ISCTR	TL	T.IS BANKASI A.Ş.					100,00	5,487700	26/11/20					7,000000	700,00	0,00	0,00
KCHOL	TL	KOÇ HOLDING A.Ş.					100,00	14,749300	27/11/20					21,120000	2.112,00	0,01	0,00
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MAD.İŞL.A.Ş.					100,00	10,603200	24/11/20					15,490000	1.549,00	0,01	0,00
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞL.A.Ş.					100,00	60,840200	27/11/20					96,700000	9.670,00	0,06	0,00
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK					100,00	5,365500	17/12/20					5,780000	578,00	0,00	0,00
MGROS	TL	MİGROS TİC.A.Ş.					100,00	18,041100	27/11/20					42,800000	4.280,00	0,02	0,00
OYAKC	TL	OYAK ÇİMENTO FAB.					15,00	8,010000	09/10/20					8,780000	131,70	0,00	0,00
PETKM	TL	PETKİM PETROKİMYA HOLDING A.Ş.					1.441.167,40	4,825034	30/12/20					4,980000	7.177.013,65	41,31	0,76
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.					100,00	56,028300	26/11/20					74,600000	7.460,00	0,04	0,00
SAHOL	TL	SABANCI HOLDING A.Ş.					100,00	8,110300	01/12/20					11,460000	1.146,00	0,01	0,00
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.					50.000,32	7,145860	22/12/20					7,310000	365.502,34	2,10	0,04
TAVHL	TL	TAV HAVA. LİM. HOLDING A.Ş.					100,00	24,565200	26/11/20					21,300000	2.130,00	0,01	0,00
TCELL	TL	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.					550.000,00	13,651858	27/11/20					16,100000	8.855.000,00	50,99	0,94
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.					100,00	12,470600	17/12/20					12,910000	1.291,00	0,01	0,00
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDING A.Ş.					100,00	19,881400	27/11/20					16,590000	1.659,00	0,01	0,00
TOASO	TL	TOASO					100,00	19,136300	27/11/20					33,920000	3.392,00	0,02	0,00
TSKB	TL	T.SINAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.					100,00	1,870000	30/10/20					1,780000	178,00	0,00	0,00
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.					100,00	6,217500	26/11/20					8,540000	854,00	0,00	0,00
TUPRS	TL	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.					100,00	109,733900	26/11/20					108,000000	10.800,00	0,06	0,00
TURSG	TL	TÜRKİYE SİGORTA A.Ş.					137.637,00	5,905934	30/12/20					6,600000	908.404,20	5,23	0,10
ULKER	TL	ÜLKER GIDA SAN. VE TİC. A.Ş.					100,00	19,093300	27/11/20					23,140000	2.314,00	0,01	0,00
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O					100,00	4,358500	27/11/20					4,710000	471,00	0,00	0,00
YKBNK	TL	YAPI VE KREDI BANKASI A.Ş.					100,00	2,044700	27/11/20					3,080000	308,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							**2.181.534,72**							**17.374.949,64**		**100,00**	**1,84**
GRUP TOPLAMI							**2.181.534,72**							**17.374.949,64**		**100,00**	**1,84**

31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası (''TL'') olarak gösterilmiştir.)

BORÇLANMA SENETLERİ																	
Devlet Tahvili																	
TRT060121T16	TL	HAZINE	06/01/21				2.000.000,00	102,945500	25/02/11	0,000000				272,003000	5.440.060,00	0,76	0,58
TRT170221T12	TL	HAZINE	17/02/21		0,00		165.000,00	93,735200	12/10/20	15,070877		72447371		103,462793	170.713,61	0,02	0,02
TRT140421T13	TL	HAZINE	14/04/21		0,00		16.419.000,00	89,569900	11/12/20	15,598361		73448834		95,992114	15.760.945,12	2,19	1,67
TRT210421T14	TL	HAZINE	21/04/21		0,00		500.000,00	98,805000	16/10/20	15,490503		72471038		105,758713	528.793,57	0,07	0,06
TRT210721T11	TL	HAZINE	21/07/21		0,00		46.000.000,00	226,015200	13/01/20	0,000000		72265237		263,254000	121.096.840,00	16,85	12,80
TRT220921T18	TL	HAZINE	22/09/21		0,00		10.900.000,00	96,512900	17/12/20	16,437280		73674399		98,142914	10.697.577,58	1,49	1,13
TRT201021T25	TL	HAZINE	20/10/21		0,00		21.000.000,00	109,729400	04/02/20	16,292377		72415623		101,333891	21.280.117,04	2,96	2,25
TRT120122T17	TL	HAZINE	12/01/22		0,00		17.800.000,00	93,098200	28/04/20	15,940428		71402395		99,064143	17.633.417,39	2,45	1,86
TRT020322T17	TL	HAZINE	02/03/22		0,00		25.000.000,00	75,640400	24/05/19	15,690596		71406271		99,391680	24.847.920,02	3,45	2,63
TRT170822T15	TL	HAZINE	17/08/22		0,00		18.100.000,00	79,269400	14/05/19	15,158939		71362731		98,476065	17.824.167,75	2,48	1,89
TRT140922T17	TL	HAZINE	14/09/22		0,00		16.107.557,00	93,730900	15/05/20	14,825830		72597729		93,985595	15.138.783,28	2,10	1,60
TRT180123T10	TL	HAZINE	18/01/23		0,00		35.000.000,00	90,456400	25/06/20	14,422297		72977721		102,500834	35.875.291,88	4,99	3,79
TRT080323T10	TL	HAZINE	08/03/23		0,00		48.500.000,00	77,113600	05/03/20	14,373707		72486954		89,820049	43.562.723,89	6,06	4,61
TRT140623T19	TL	HAZINE	14/06/23		0,00		24.000.000,00	90,658600	13/02/20	14,443294		72455260		105,306916	25.273.659,95	3,51	2,67
TRT270923T11	TL	HAZINE	27/09/23		0,00		7.900.000,00	95,060300	19/02/20	14,236678		72479016		91,257275	7.209.324,71	1,00	0,76
TRT081123T10	TL	HAZINE	08/11/23		2,66		1.000.000,00	101,333000	02/12/13	1,804465				225,239620	2.252.396,20	0,31	0,24
TRT200324T13	TL	HAZINE	20/03/24		0,00		200.000,00	77,426900	05/07/19	13,911101		71311273		95,112925	190.225,85	0,03	0,02
TRT240724T15	TL	HAZINE	24/07/24		0,00		18.700.000,00	91,954400	16/07/20	13,494452		73064775		92,614111	17.318.838,72	2,41	1,83
TRT120325T12	TL	HAZINE	12/03/25		0,00		890.000,00	64,401200	26/06/19	13,365786		71378564		86,759820	772.162,40	0,11	0,08
TRT110226T13	TL	HAZINE	11/02/26		0,00		112.900.000,00	98,127600	13/11/20	12,845105		73527971		97,138146	109.668.966,48	15,25	11,59
TRT240227T17	TL	HAZINE	24/02/27		0,00		42.800.000,00	98,056300	10/08/20	13,003484		73151883		97,015497	41.522.632,56	5,77	4,39
TRT110827T16	TL	HAZINE	11/08/27		0,00		92.753.000,00	93,294500	13/11/20	12,897311		73527971		95,146619	88.251.343,63	12,27	9,33
TRT080328T15	TL	HAZINE	08/03/28		0,00		23.560.000,00	105,436600	07/08/20	12,982871		73151883		102,895407	24.242.157,85	3,37	2,56
GRUP TOPLAMI							**582.194.557,00**							**646.559.059,48**		**89,90**	**68,36**
Özel Sektör																	
Finansman Bonosu																	
TRFTEBK32123	TL	TEB	12/03/21		9,40		5.000.000,00	100,000000	12/06/20	9,764618				100,537467	5.026.873,36	0,70	0,53
GRUP TOPLAMI							**5.000.000,00**							**5.026.873,36**		**0,70**	**0,53**
Özel Sektör Tahvil																	
TRSTPRS12115	TL	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	22/01/21		25,29		2.500.000,00	100,000000	25/01/19	20,789948				102,587083	2.564.677,06	0,36	0,27
TRSISGY12113	TL	İŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	25/01/21		26,51		300.000,00	100,000000	15/10/20	16,981468				102,964421	308.893,26	0,04	0,03
TRSTISB72712	TL	T.IS BANKASI A.Ş.	27/07/27		13,91		1.000.000,00	100,000000	08/08/17	18,275833				103,072097	1.030.720,97	0,14	0,11
TRSVKFB92719	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O	06/09/27		0,00		29.600.000,00	100,012100	23/01/20	15,933599		668		107,328919	31.769.360,12	4,42	3,36
TRSTHALE2716	TL	HALK BANKASI A.Ş.	22/10/27		42,00		9.000.000,00	100,000000	20/10/17	16,923087				99,870878	8.988.379,05	1,25	0,95
TRSSKBKA2716	TL	ŞEKERBANK T.A.Ş.	10/12/27		17,28		1.000.000,00	100,000000	22/12/17	19,987849				98,984009	989.840,09	0,14	0,10
TRSTISB62911	TL	T.IS BANKASI A.Ş.	06/06/29		27,61		5.000.000,00	100,000000	19/06/19	18,279614				101,308199	5.065.409,93	0,70	0,54
GRUP TOPLAMI							**48.400.000,00**							**50.717.280,48**		**7,05**	**5,36**
GRUP TOPLAMI							**53.400.000,00**							**55.744.153,84**		**7,75**	**5,89**
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet																	
TRPTYV232410	TL	Türkiye Kalkınma ve Yatırım Bankası A.Ş. Varlık Finansmanı Fonu	15/03/24		16,75		14.990.000,00	100,000000	09/08/19	12,484133				112,971486	16.934.425,71	2,35	1,79
GRUP TOPLAMI							**14.990.000,00**							**16.934.425,71**		**2,35**	**1,79**
GRUP TOPLAMI							**650.584.557,00**							**719.237.639,03**		**100,00**	**76,04**
T.REPO																	
TRT020823T11	TL	HAZINE	04/01/21		17,97		16.031.509,04	17,970000	31/12/20		7.193.600,00	7372984	16.031.509,04	17,960000	16.007.884,58	94,12	1,69
TRT261022T10	TL	HAZINE	04/01/21		17,97		1.001.969,32	17,970000	31/12/20		431.820,00	73729842	1.001.969,32	17,960000	1.000.492,79	5,88	0,11
GRUP TOPLAMI							**17.033.478,36**							**17.008.377,37**		**100,00**	**1,80**

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. VEM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası (''TL'') olarak gösterilmiştir.)

GRUP TOPLAMI							**17.033.478,36**							**17.008.377,37**		**100,00**	**1,80**
MEVDUAT																	
AKBANK	TL		04/01/21		18,00		15.594.535,52		28/12/20				15.648.368,71	18,000000	15.625.274,62	43,81	1,65
AKBANK	TL		29/01/21		18,25		20.000.000,00		28/12/20				20.320.000,00	18,250000	20.040.396,43	56,19	2,12
GRUP TOPLAMI							**35.594.535,52**							**35.665.671,05**		**100,00**	**3,77**
GRUP TOPLAMI							**35.594.535,52**							**35.665.671,05**		**100,00**	**3,77**
TPP																	
TPP			04/01/21		17,70		208.403,46	17,700000	31/12/20			220962	208.403,46	17,970000	208.096,18	100,00	0,02
GRUP TOPLAMI							**208.403,46**							**208.096,18**		**100,00**	**0,02**
GRUP TOPLAMI							**208.403,46**							**208.096,18**		**100,00**	**0,02**
DİĞER																	
Y.Fonu Türk																	
Z30EAF	TL	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.					772.979,00	13,698501	23/09/20					19,390000	14.988.062,81	9,59	1,59
ZPBDLF	TL	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.					248.479,00	19,557598	21/12/20					20,160000	5.009.336,64	3,20	0,53
ZPLIBF	TL	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.					1.790.635,00	12,947982	17/12/20					15,290000	27.378.809,15	17,52	2,89
ZPX30F	TL	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.					4.793.642,00	14,906803	30/12/20					18,850000	90.360.151,70	57,80	9,55
ZRE20F	TL	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.					607.637,00	15,171354	30/12/20					18,342000	11.145.277,85	7,13	1,18
ZTM15F	TL	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.					408.247,00	13,855813	30/12/20					18,210000	7.434.177,87	4,76	0,79
GRUP TOPLAMI							**8.621.619,00**							**156.315.816,02**		**100,00**	**16,53**
GRUP TOPLAMI							**8.621.619,00**							**156.315.816,02**		**100,00**	**16,53**
FON PORTFÖY DEĞERİ														**945.810.549,29**			**100,00**

31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası (''TL'') olarak gösterilmiştir.)

			31 Aralık 2020
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
Fon portföy değeri	**945.810.549**		**100,15**
Hazır değerler	**522**		
Kasa	0	0,00	0,00
Bankalar	522	100,00	0,00
Diğer hazır değerler	0	0,00	0,00
Alacaklar	**90.977**		
Takastan alacaklar	0	0,00	0,00
Diğer alacaklar	90.977	100,00	0,01
Borçlar	**(1.529.317)**		
Takasa Borçlar	0	0,00	0,00
Banka kredileri	0	0,00	0,00
Fon yönetim ücretleri	(1.475.979)	96,51	-0,16
Hisse senedi alım borçları	0	0,00	0,00
Diğer borçlar	(24.990)	1,63	0,00
Kayda alma ücreti	(28.348)	1,85	0,00
Fon toplam değeri	**944.372.732**		**100**