

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
ALTERNATİF STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU
31.12.2015

I - Fon Bilgileri

İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi : 29.05.2014
İzahname Ticaret Sicili Tescil Tarihi : 07.07.2014
Halka Arz Tarihi : 16.07.2014
Fon'un Türü : Standart Fon
Faaliyeti : Portföy İşletmeciliği
Kayda Alınmış Nominal Fon Tutarı : 10.000.000.000 -TL
Risk Grubu : Düşük Risk Grubu
Portföy Yöneticisi : Ergo Portföy Yönetimi A.Ş.
Fon Kurulu Üyeleri : Fon Kurulu Başkanı AYHAN SİNCEK
Üye İSMAİL AYDEMİR
Üye FATİH BOZKURT
Üye MURAT VANLI
Fon Müdürü : Fatih BOZKURT
Fon Denetçisi : İbrahim Gökdemir
Telefon No / Faks No : 0.216.999.81.00 / 0.216.692.12.88
E-mail Adresi : kefonyonetimi@katilimemeklilik.com.tr
Web Adresi : www.katilimemeklilik.com.tr

Tanım

Emeklilik Yatırım Fonu, Emeklilik Şirketleri tarafından emeklilik sözleşmesi çerçevesinde alınan ve katılımcılar adına bireysel emeklilik hesaplarında izlenen katkıların, riskin dağıtılması ve inançlı mülkiyet esaslarına göre işletilmesi amacıyla oluşturulan malvarlığıdır. Süresiz olarak kurulan fonun tüzel kişiliği yoktur. Fon, Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. emeklilik planları kapsamında katılımcılara sunulur.

Fonun Amacı

Fon portföyünde özellikle kira sertifikaları ağırlıklı olmak üzere, katılım bankacılığı esaslarına uygun farklı yatırım araçlarına da yer verilerek, yatırımcılara uzun vadede istikrarlı ve göreceli olarak daha az dalgalanan bir getiri performansı sunulması hedeflenir.

Yatırım Stratejisi

Fon yönetiminde ilgili Yönetmelik hükümleri saklı kalmak üzere aşağıdaki sınırlamalara uyulur.

	EN	AZ	EN	ÇOK
VARLIK TÜRÜ	%		%	

Hazine Müsteşarlığı'nca ihraç edilen Türk Lirası cinsinden Kira Sertifikaları	70	100
Borsada işlem görmesi şartı ile bankalar veya yatırım yapılabilir seviyede derecelendirme notuna sahip olan ihraççılar tarafından ihraç edilen Türk Lirası cinsinden faizsiz borçlanma araçları ve Kurul kaydından bulunan özel sektör kira sertifikaları	0	30
Türk Ortaklık Payları (katılım endeksi kapsamındaki ortaklık payları)	0	30
TL Cinsinden Katılma Hesabı	0	25

Fon'un karşılaştırma ölçütü, portföyün yatırım amaç ve stratejisi ile portföydeki ağırlıkları dikkate alınarak her vadedeki kamu kira sertifikası, özel sektör kira sertifikası ve karpayı işlemlerinin getirisini temsil eden endekstir.

Fonun karşılaştırma ölçütü aşağıdaki gibi hesaplanır:

- + %90 KYD Kamu Kira Sertifikası Endeksi
- + %9 KYD KYD 1 Aylık Kar Payı Endeksi TL
- + %1 KYD Özel Sektör Kira Sertifikası Endeksi

Karşılaştırma ölçütü dikkate alınmakla birlikte piyasa koşullarına göre, karşılaştırma ölçütünde yer alan varlıklara aşağıdaki alt ve üst bant içerisinde kalmak suretiyle yatırım yapılabilir:

Fon Kuruluş Bilgileri

Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 26.05.2014 tarih, 12233903-310.01.01 – 426 sayılı izinle kuruluşuna izin verilen Fon'un içtüzüğü 29.05.2014 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından 895027 sayı ile tescil edilmiş olup 04.06.2014 tarih, 8583 sayılı Ticaret Sicili Gazetesi'nde ilan edilmiştir.

03.07.2014 tarihinde Sermaye Piyasası tarafından EYF. 238 / 629 sayılı belge ile kayda alınan Fon, Ümraniye Vergi Dairesi'nin mükellefidir.

Katılımcıları bilgilendirme amaçlı fon izahnamesi 07.07.2014 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından tescil edilmiş ve 11.07.2014 tarih, 8610 sayılı Türkiye Ticaret Sicili Gazetesinde ilan edilmiştir. 16 Temmuz 2014 tarihinden itibaren Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. emeklilik planları içerisinde katılımcılara sunulmaya başlanmıştır.

Dönem İçinde Meydana Gelen Değişiklikler

Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 09.06.2015 tarih ve 5734 sayılı izin doğrultusunda 29.06.2015 tarihinden itibaren geçerli olmak üzere;

*Alternatif Standart Fon'da Hazine Müsteşarlığı'nca ihraç edilen kira sertifikaları yatırım oranı en az %70 olarak değiştirilmiştir.

*Fon muhasebecisi olarak Ömer Can HERGENÇ'in yerine Fatih İlker YİĞİT atanmıştır.

*Fonun yatırım yapacağı sermaye piyasası araçlarının seçimi ve riskin dağıtılması Gelir ortaklığı senetleri ve varlığa dayalı menkul kıymetler kaldırılmıştır, BİST Katılım Endeksi, Katılım Endeksi olarak değiştirilmiştir.

Döneme Ait Fon İşlemleri

Fon portföyünün aylık bazda ortalama varlık dağılımı aşağıdaki gibi gerçekleşmiştir.

Ay	Kira Sertifikası Kamu	Kira Sertifikası Özel	Katılma Hesabı
OCAK	80,33%	10,90%	8,77%
ŞUBAT	77,28%	16,24%	6,48%

MART	67,27%	23,66%	9,07%
NİSAN	61,59%	23,95%	14,46%
MAYIS	61,36%	24,46%	14,18%
HAZİRAN	63,11%	27,76%	9,13%
TEMMUZ	70,52%	19,52%	9,96%
AĞUSTOS	71,35%	17,30%	11,35%
EYLÜL	71,11%	15,48%	13,41%
EKİM	70,40%	17,03%	12,57%
KASIM	71,38%	18,54%	10,08%
ARALIK	70,53%	18,22%	11,25%

Fon'un kamu ve özel sektör kira sertifikası, Katılım Endeksi ortaklık payı Bizim Menkul Değerler A.Ş. aracılığı ile yapılmıştır. Fon'a ait kıymetler Takasbank'daki fon deposunda saklanmaktadır. Fon nakdi ve nakit hareketleri Bizim Menkul Değerler A.Ş Genel Müdürlük ve Kuveyt Türk Katılım Bankası A.Ş. Zincirlikuyu Merkez Şubesi'ndeki fon hesaplarında izlenmektedir.

Fon'un nakit ve varlık takas işlemleri Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. Fon Yönetimi ve Fon Hizmet Birimi, Kuveyt Türk ve Bizim Menkul Değerler A.Ş. koordinasyonunda Takasbank uzaktan erişim sistemi, Kuveyt Türk Nakit Yönetimi Sistemi ve yazılı talimatlar aracılığıyla gerçekleştirilmektedir.

Fon fiyatı, portföy yapısı ve fon performansı ile ilgili bilgiler www.katilimemeklilik.com.tr sitesinde hergün yayınlanmaktadır.

Fonun Performansına İlişkin Bilgiler

Fon portföyü, 05.06.2014 tarihinde Kurucu tarafından tahsis edilen 1.050.000 TL avans ile oluşturulmuştur.

01.01.2015– 31.12.2015 döneminde;

Fon'un Birim Pay Fiyatı %6,95 Fon'un Karşılaştırma Ölçütü %8,74

performans göstermiştir.

AYHAN SİNCEK
Fon Kurulu Başkanı

İSMAİL AYDEMİR
Fon Kurulu Üyesi

FATİH BOZKURT
Fon Kurulu Üyesi

MURAT VANLI
Fon Kurulu Üyesi