

KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
ALTERNATİF ESNEK EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU
31.12.2016

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 | : Diğer Fonlar – Esnek Fon | |
| Faaliyeti | : Portföy İşletmeciliği | |
| Kayda Alınmış Nominal Fon Tutarı | : 10.000.000.000 -TL | |
| Risk Grubu | : Orta Risk Grubu | |
| Portföy Yöneticisi | : Q Invest Portföy Yönetimi A.Ş. | |
| Fon Kurulu Üyeleri | : Fon Kurulu Başkanı Üye Üye Üye Üye | AYHAN SİNCEK İSMAİL AYDEMİR FATİH BOZKURT MURAT VANLI ÖMER CAN HERGENÇ |
| Fon Müdürü | : Fatih BOZKURT | |
| Fon Denetçisi | : İbrahim Gökdemir | |
| Telefon No / Faks No | : 0.216.999.81.00 / 0.216.692.11.22 | |
| 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

Portföyünde katılım bankacılığı esaslarına uygun olan farklı yatırım araçlarına yer verilerek yatırım araçlarının çeşitlendirilmesi ile uzun vadede istikrarlı getiri elde edilmesidir

Yatırım Stratejisi

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

| VARLIK TÜRÜ | EN AZ % | EN ÇOK % |
|---|---------|----------|
| Türk Ortaklık Payları | 0 | 100 |
| Yabancı Ortaklık Payları | 0 | 100 |
| Katılma Hesapları (TL-Döviz) | 0 | 25 |
| Türkiye’de ve Uluslararası Piyasalarda İhraç Edilen Kira Sertifikaları (TL-Döviz) | 0 | 100 |
| Türkiye’de ve Uluslararası Piyasalarda İhraç Edilen Altın ve Kıymetli Madenler ile Bunlara Dayalı Sermaye Piyasası Araçları (TL-Döviz) | 0 | 100 |
| Türkiye’de ve Uluslararası Piyasalarda İhraç Edilen Faizsiz Borçlanma Araçları(TL-Döviz) | 0 | 100 |
| Faizsiz ve Katılım Bankacılığı Esaslarına Uygun Olması Koşulu İle Girişim Sermayesi Yatırım Ortaklıkları Tarafından İhraç Edilen Para ve Sermaye Piyasası Araçları/Girişim Sermayesi Yatırım Fonu Katılma Payları | 0 | 20 |
| Yatırım Fonu / Borsa Yatırım Fonu / Yabancı Yatırım Fonu/ Yabancı Borsa Yatırım Katılma Payları | 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, katılım endeksi ve karpayı işlemlerinin getirisini temsil eden endekstir.

Fonun eşik değeri aşağıdaki gibi hesaplanır:

*BİST-KYD Kira Sertifikaları Kamu Endeksi * %100

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. 240 / 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

- Fon Kurulu Üyesi olarak Ömer Can HERGENÇ atanmıştır.
- Fonumuzu Yöneten Portföy Yönetim Şirketi Ergo Portföy, satış nedeniyle isim değiştirerek Q Invest Portföy Yönetim Şirketi ismi ile faaliyetlerine devam etmektedir.
- Portföy Yöneticisi Serap Özübek KAYA görevinden ayrılmış ve yerine Buğra BİLGİ atanmıştır.
- Emeklilik Yatırım Fonlarına dair rehber kapsamında tadil başvuruları SPK’ya yapılmıştır.

Döneme Ait Fon İşlemleri

Fon portföyünün aylık bazda ortalama varlık dağılımı aşağıdaki gibi gerçekleşmiştir.

| Yıl | Ay | Kira Sertifikası Kamu | Kira Sertifikası Özel | Katılma Hesabı | Ortaklık Payı |
|------|---------|-----------------------|-----------------------|----------------|---------------|
| 2016 | OCAK | 42,18% | 10,59% | 20,11% | 27,12% |
| 2016 | ŞUBAT | 50,11% | 10,38% | 9,63% | 29,88% |
| 2016 | MART | 62,10% | 11,86% | 0,00% | 26,04% |
| 2016 | NİSAN | 59,95% | 20,77% | 0,66% | 18,62% |
| 2016 | MAYIS | 54,10% | 23,13% | 3,52% | 19,25% |
| 2016 | HAZİRAN | 48,54% | 25,12% | 4,02% | 22,32% |
| 2016 | TEMMUZ | 47,09% | 25,95% | 4,27% | 22,69% |
| 2016 | AĞUSTOS | 42,90% | 25,14% | 5,99% | 25,97% |
| 2016 | EYLÜL | 43,14% | 24,82% | 6,64% | 25,40% |
| 2016 | EKİM | 46,06% | 24,04% | 3,64% | 26,26% |
| 2016 | KASIM | 48,60% | 27,01% | 0,60% | 23,79% |
| 2016 | ARALIK | 50,10% | 26,89% | 0,00% | 23,01% |

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, 04.06.2014 tarihinde Kurucu tarafından tahsis edilen 1.050.000 TL avans ile oluşturulmuştur.

01.01.2016– 31.12.2016 döneminde;

Fon'un Birim Pay Fiyatı %8,03

Eşik Değer Ölçütü %8,50

performans göstermiştir.

Fon Kurulu Başkanı
Ayhan Sincek

Fon Kurulu Üyesi
İsmail Aydemir

Fon Kurulu Üyesi
Fatih Bozkurt

Fon Kurulu Üyesi
Murat Vanlı

Fon Kurulu Üyesi
Ömer Can Hergenç