

**KATILIM EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.**  
**ALTERNATİF İKİNCİ ESNEK (DÖVİZ) EMEKLİLİK YATIRIM FONU**  
**FAALİYET RAPORU**  
**31.12.2015**

**I - Fon Bilgileri**

İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi : 22.07.2015

İzahname Ticaret Sicili Tescil Tarihi : 31.12.2015

Halka Arz Tarihi : 18.01.2016

Fon'un Türü : Esnek Fon

Faaliyeti : Portföy İşletmeciliği

Kayda Alınmış Nominal Fon Tutarı : 10.000.000.000 -TL

Risk Grubu : Orta 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**

Portföyünde katılım bankacılığı esaslarına uygun olan döviz cinsi kira sertifikalarına, döviz katılma hesabına ve (3) nolu varlık tablosunda belirtilen döviz cinsinden diğer yatırım araçlarına yatırım yaparak kur hareketlerinden ve kira sertifikası yatırımlarından getiri elde etmeyi amaçlamaktadır.

**Yatırım Stratejisi**

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

| <b>VARLIK TÜRÜ</b>  | <b>EN AZ %</b> | <b>EN ÇOK %</b> |
|---|----------------|-----------------|
| Döviz Cinsinden İhraç Edilen Para ve Sermaye Piyasası Araçları*                                   | 80             | 100             |
| Türkiye’de ve Uluslararası Piyasalarda Döviz Cinsinden İhraç Edilen Kira Sertifikaları (USD-EURO) | 30             | 100             |
| Türk Ortaklık Payları*  | 0              | 20              |
| Yabancı Ortaklık Payları*   | 0              | 70              |
| Katılma Hesabı (USD-EURO-TL)  | 0              | 25              |
| Altın ve Diğer Kıymetli Madenler ile Bunlara Dayalı Sermaye Piyasası Araçları                     | 0              | 20              |
| Yatırım Fonu/Borsa Yatırım Fonu/Yabancı Yatırım Fonu/ Yabancı Borsa Yatırım Fonu Katılma Payları* | 0              | 20              |
| Kira Sertifikaları (TL)   | 0              | 20              |

Fon’un karşılaştırma ölçütü, portföyün yatırım amaç ve stratejisi ile portföydeki ağırlıkları dikkate alınarak her vadedeki Döviz cinsi ağırlıklı kira sertifikası, döviz cinsi ağırlıklı katılım endeksi ve karpayı işlemlerinin getirisini temsil eden endekstir.

Fonun eşik değeri aşağıdaki gibi hesaplanır:

BİST-KYD 1 Aylık Kar Payı USD olarak belirlenmiştir. (TL cinsinden hesaplanacaktır.)

### **Fon Kuruluş Bilgileri**

Sermaye Piyasası Kurulu’ndan alınan 15.07.2015 tarih, 12233903.310.01.01-E.7403 sayılı izinle kuruluşuna izin verilen Fon’un içtüzüğü 22.07.2015 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından 895027 sayı ile tescil edilmiş olup 28.07.2015 tarih, 8871 sayılı Ticaret Sicili Gazetesi’nde ilan edilmiştir.

23.12.2015 tarihinde Sermaye Piyasası tarafından EYF. 251 / 832 sayılı belge ile kayda alınan Fon, Ümraniye Vergi Dairesi’nin mükellefidir.

Katılımcıları bilgilendirme amaçlı fon izahnamesi 31.12.2015 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından tescil edilmiş ve 07.01.2016 tarih, 8984 sayılı Türkiye Ticaret Sicili Gazetesinde ilan edilmiştir. 18 Ocak 2016 tarihinden itibaren Katılım Emeklilik ve Hayat A.Ş. emeklilik planları içerisinde katılımcılara sunulmaya başlanmıştır.

### **Dönem İçinde Meydana Gelen Değişiklikler**

#### **Döneme Ait Fon İşlemleri**

Fon portföyünün aylık bazda ortalama varlık dağılımı aşağıdaki gibi gerçekleşmiştir.

| <b>Ay</b> | <b>Kira Sertifikası</b> |
|-----------|-------------------------|
| EKİM      | 100,00%                 |
| KASIM     | 100,00%                 |
| ARALIK    | 100,00%                 |

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](http://www.katilimemeklilik.com.tr) sitesinde hergün yayınlanmaktadır.

### **Fonun Performansına İlişkin Bilgiler**

Fon portföyü, 19.10.2015 tarihinde Kurucu tarafından tahsis edilen 1.300.000 TL avans ile oluşturulmuştur.

19.10.2015– 31.12.2015 döneminde;

|                         |       |            |       |
|-------------------------|-------|------------|-------|
| Fon'un Birim Pay Fiyatı | %0,27 | Eşik Değer | %0,27 |
|-------------------------|-------|------------|-------|

performans göstermiştir.

AYHAN SİNCEK  
Fon Kurulu Başkanı

İSMAİL AYDEMİR  
Fon Kurulu Üyesi

FATİH BOZKURT  
Fon Kurulu Üyesi

MURAT VANLI  
Fon Kurulu Üyesi