

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 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



**TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM HİSSE SENEDİ 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**

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Katılım Hisse Senedi 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 İlişkin Tebliğ (II-14.2)” hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca (“SPK”) belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu’nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2023 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Fon’un 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 İlişkin Tebliğ (II-14.2)” hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Türkiye Hayat ve Emeklilik 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.



Ramazan Yüksekaya, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 1 Nisan 2024

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-3
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	4

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

KATILIM HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HISSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	328.370	76,0347	18/10/23	-	-	-	103,00	-	33.822.110	3,69	3,36
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	(55.000)	76,0347	28/12/23	-	-	-	103,00	-	(5.665.000)	(0,62)	(0,56)
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	AKSEN	-	-	1.023.878	38,9195	23/10/23	-	-	-	29,74	-	30.450.132	3,32	3,02
	ALBARAKA TÜRK KATILIM BANKASI A.S.	-	ALBRK	-	-	1.859.551	2,1947	18/10/23	-	-	-	3,82	-	7.103.485	0,77	0,71
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.	-	ARDYZ	-	-	1.120.415	17,5505	18/10/23	-	-	-	26,08	-	29.220.423	3,19	2,90
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AS	-	ASELS	-	-	2.025.950	31,0765	28/12/23	-	-	-	44,98	-	91.127.231	9,94	9,05
	BAŞKENT DOĞALGAZ DAĞITIM GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş. BASGZ	-	BASGZ	-	-	113.256	15,2030	18/10/23	-	-	-	18,71	-	2.119.020	0,23	0,21
	BİOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	2.306.153	18,4889	18/10/23	-	-	-	17,20	-	39.665.832	4,33	3,94
	CW ENERJİ MÜHENDİSLİK TİCARET VE SANAYİ A.Ş.	-	CWENE	-	-	62.221	386,4754	18/10/23	-	-	-	271,25	-	16.877.446	1,84	1,68
	DOĞANLAR MOBİLYA GRUBU İMALAT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	DGNMO	-	-	1.269.884	6,8149	29/12/23	-	-	-	9,37	-	11.898.813	1,30	1,18
	DOĞUŞ OTOM.SERVİS VE TİC.A.Ş.	-	DOAS	-	-	36.712	142,8331	18/10/23	-	-	-	257,00	-	9.434.984	1,03	0,94
	EBEBEK MAĞAZACILIK A.Ş.	-	EBEBK	-	-	93.400	68,4175	11/12/23	-	-	-	72,80	-	6.799.520	0,74	0,68
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.	-	ENJSA	-	-	10	28,0800	03/05/23	-	-	-	45,54	-	455	0,00	0,00
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	2.192.746	37,9036	28/12/23	-	-	-	41,00	-	89.902.586	9,80	8,93
	GİRİŞİM ELEKTRİK SANAYİ TAAHHÜT VE TİCARET A.Ş.	-	GESAN	-	-	10	70,2500	03/05/23	-	-	-	66,60	-	666	0,00	0,00
	GOODYEAR LASTİKLERİ T.A.Ş.	-	GOODY	-	-	190.788	14,1285	18/10/23	-	-	-	18,72	-	3.571.551	0,39	0,35
	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	-	GUBRF	-	-	41.225	146,4059	18/10/23	-	-	-	153,80	-	6.340.405	0,69	0,63
	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	ISDMR	-	-	399.290	31,6338	28/12/23	-	-	-	34,60	-	13.815.434	1,51	1,37
	JANTSA JANT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	JANTS	-	-	46.421	95,3625	18/10/23	-	-	-	130,80	-	6.071.867	0,66	0,60
	KALEKİM KİMYEVİ MADDELER SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KLKIM	-	-	270.000	29,5222	25/10/23	-	-	-	21,50	-	5.805.000	0,63	0,58
	KONYA KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KONKA	-	-	308.271	46,6466	18/10/23	-	-	-	47,00	-	14.488.737	1,58	1,44
	KONTROLMATİK TEKNOLOJİ ENERJİ VE MÜHENDİSLİK A.Ş.	-	KONTR	-	-	20	136,9000	06/04/23	-	-	-	217,00	-	4.340	0,00	0,00
	KONYA KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KONYA	-	-	10	953,4800	28/01/22	-	-	-	7.205,00	-	72.050	0,01	0,01
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	-	2.005.010	22,5729	28/12/23	-	-	-	23,76	-	47.639.038	5,19	4,73
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	-	1.050.000	23,6038	28/12/23	-	-	-	23,76	-	24.948.000	2,72	2,48
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	454.214	16,4109	18/10/23	-	-	-	20,98	-	9.529.400	1,04	0,95

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

KATILIM HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
	LOKMAN HEKİM ENGÜRÜSAĞ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAAHHÜT A.Ş.	-	LKMNH	-	-	184.262	36,1790	11/12/23	-	-	-	64,70	-	11.921.751	1,30	1,18
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	286.656	41,2941	18/10/23	-	-	-	116,50	-	33.395.424	3,64	3,32
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	-	MPARK	-	-	251.461	86,9133	01/12/23	-	-	-	149,00	-	37.467.689	4,09	3,72
	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN.TİC.A.Ş.	-	ODAS	-	-	524.443	8,7213	18/10/23	-	-	-	8,25	-	4.326.655	0,47	0,43
	PANELSAN ÇATI CEPHE SİSTEMLERİ SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	PNLSN	-	-	513.718	62,1011	18/10/23	-	-	-	56,40	-	28.973.695	3,16	2,88
	PASİFİK GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	-	PSGYO	-	-	2	2,6432	06/09/23	-	-	-	4,99	-	11	0,00	0,00
	SMART GÜNEŞ ENERJİSİ TEKNOLOJİLERİ ARAŞTIRMA GELİŞTİRME ÜRETİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	SMRTG	-	-	20	35,6818	28/07/23	-	-	-	55,25	-	1.094	0,00	0,00
	SİNPAŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	-	SNGYO	-	-	10	4,3900	05/10/22	-	-	-	2,73	-	27	0,00	0,00
	SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.	-	SUWEN	-	-	1.245.592	10,2593	18/10/23	-	-	-	25,68	-	31.986.803	3,49	3,18
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	156.845	93,8371	28/12/23	-	-	-	228,60	-	35.854.767	3,91	3,56
	TEKFEN HOLDING A.Ş.	-	TKFEN	-	-	10	29,7800	03/05/23	-	-	-	36,92	-	369	0,00	0,00
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	642.271	77,3089	28/12/23	-	-	-	143,00	-	91.844.753	10,03	9,12
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	VESBE	-	-	1.674.932	14,6114	25/10/23	-	-	-	16,00	-	26.798.912	2,92	2,66
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.	-	YATAS	-	-	486.930	21,0671	18/10/23	-	-	-	24,24	-	11.803.183	1,29	1,17
	YAYLA AGRO GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	YYLGD	-	-	1.538.118	15,7540	18/10/23	-	-	-	12,77	-	19.641.769	2,14	1,95
	ALCATEL LUCENT TELETAŞ TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	ALCTL	-	-	95.413	52,7500	18/10/23	-	-	-	76,35	-	7.284.783	0,79	0,72
	ALCATEL LUCENT TELETAŞ TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	ALCTL	-	-	(30.000)	52,7500	28/12/23	-	-	-	76,35	-	(2.290.500)	(0,25)	(0,23)
	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş.	-	ALKIM	-	-	489.769	39,9583	18/10/23	-	-	-	34,08	-	16.691.327	1,82	1,66
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	BIMAS	-	-	116.203	142,3389	28/12/23	-	-	-	300,75	-	34.948.052	3,81	3,47
	ESCORT TEKNOLOJİ YATIRIM A.Ş.	-	ESCOM	-	-	281.273	29,9172	18/10/23	-	-	-	40,86	-	11.492.815	1,25	1,14
	LOGO YAZILIM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	LOGO	-	-	200.000	69,6043	23/10/23	-	-	-	73,95	-	14.790.000	1,61	1,47
	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.	-	SASA	-	-	139.258	28,4428	08/11/23	-	-	-	36,44	-	5.074.569	0,55	0,50
GRUP TOPLAMI						25.939.991								917.051.472	100,00	91,08

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

KATILIM HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
KATILIM HESABI																
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	37,00	-	13.250.000	-	29/12/23	-	-	13.303.726	37,00	-	13.303.726	100,00	1,32
GRUP TOPLAMI						13.250.000								13.303.726	100,00	1,32
DİĞER																
Borsa Y.Fonu Türk																
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KEF	-	-	315.037	44,1504	18/10/23	-	-	-	79,88	-	25.165.156	32,35	2,50
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KPF	-	-	276.593	60,2651	18/10/23	-	-	-	110,81	-	30.648.994	39,41	3,04
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZGOLDF	-	-	10	93,9450	17/10/22	-	-	-	245,00	-	2.450	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						591.640								55.816.599	71,76	5,54
Y.Fonu Türk																
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	HPV	-	-	2.344.677	2,1325	04/01/23	-	-	-	2,75	-	6.442.671	8,28	0,64
	LETVEN CAPITAL GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	LDG	-	-	3.817.582	0,3578	18/02/22	-	-	-	1,59	-	6.076.892	7,81	0,60
	ACTUS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	PYT	-	-	1.043.395	1,9168	22/12/21	-	-	-	9,06	-	9.449.745	12,15	0,94
GRUP TOPLAMI						7.205.654								21.969.307		2,18
FON PORTFÖY DEĞERİ														1.008.141.105		100,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2023		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	1.008.141.105	-	100,12
B. HAZIR DEĞERLER	55.769	-	0,01
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	55.769	100,00	0,01
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C. ALACAKLAR	33.016.453	-	3,28
a) Takastan Alacaklar Toplamı	32.946.825	100,00	3,27
i) T1 Alacakları	32.946.824,95	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	69.628	-	0,01
i) Diğer Alacaklar	69.628	-	0,01
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	-	-	-
D. BORÇLAR	(34.232.037)	-	(3,40)
a) Takasa Borçlar	(24.783.964)	72,40	(2,46)
i) Takasa Borçlar T1	(24.783.964,22)	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(7.473.481,44)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(1.931.697)	5,64	(0,19)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	0,00	-
e) DİĞER BORÇLAR	(12.685)	0,13	-
i) Diğer Borçlar	(8.486,07)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(4.199,26)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(30.208,80)	0,09	(0,00)
g) Krediler	-	-	-

Fon Toplam Değeri	1.006.981.290	100,00
--------------------------	----------------------	---------------

Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	92.827.432.748,099
Fon toplam değeri (TL)	1.006.981.289,55
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	7.172.567.251,901
Birim pay değeri (TL)	0,140393