

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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



AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

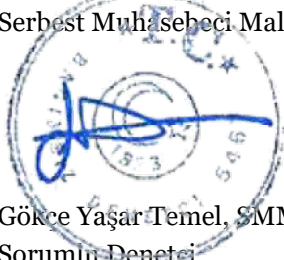
**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Agesa Hayat ve Emeklilik A.Ş. Borçlanma Araçları Grup 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 belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2023 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Agesa Hayat ve Emeklilik A.Ş. Borçlanma Araçları Grup Emeklilik Yatırım Fonu'nun 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 Agesa 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.



Gökçe Yaşar Temel, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 1 Nisan 2024

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-4
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	5

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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																
	SAHOL	-	SAHOL	-	-	1	9,4600	09/10/19	-	-	-	60,45	-	60	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1								60	100,00	0,00
BORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvili																
	HAZİNE	17/04/24	TRT170424T17	106,20	-	212.000	107,7294	18/05/23	33,3705	-	-	101,51	-	215.199	0,07	0,05
	HAZİNE	24/07/24	TRT240724T15	0,00	-	77.000	101,2715	09/02/23	42,2498	-	-	90,14	-	69.404	0,02	0,02
	HAZİNE	01/10/25	TRT011025T16	71,20	-	20.000.000	80,9192	29/12/23	39,3301	-	-	74,33	-	14.866.673	4,74	3,35
	HAZİNE	11/08/27	TRT110827T16	90,50	-	300.000	93,8180	05/07/23	25,9859	-	-	71,68	-	215.040	0,07	0,05
	HAZİNE	15/09/27	TRT150927T11	100,35	-	500.000	103,1884	13/03/23	30,1291	-	-	63,33	-	316.640	0,10	0,07
	HAZİNE	08/03/28	TRT080328T15	89,00	-	400.000	88,1004	31/01/23	26,7524	-	-	71,82	-	287.289	0,09	0,06
	HAZİNE	19/07/28	TRT190728T18	66,00	-	500.000	71,4181	17/11/23	26,0647	-	-	88,38	-	441.911	0,14	0,10
	HAZİNE	13/09/28	TRT130928T12	87,00	-	20.000.000	91,4560	28/12/23	21,8829	-	-	91,80	-	18.359.438	5,86	4,14
	HAZİNE	03/10/29	TRT031029T10	81,00	-	20.000.000	82,6200	16/11/23	21,2868	-	-	90,90	-	18.179.814	5,80	4,10
	HAZİNE	13/11/30	TRT131130T14	0,00	-	263.000	111,5060	05/04/23	23,1179	-	-	65,90	-	173.321	0,06	0,04
	HAZİNE	12/01/33	TRT120133T14	0,00	-	1.500.000	131,8770	17/08/23	0,0001	-	-	157,83	-	2.367.470	0,76	0,53
	HAZİNE	05/10/33	TRT051033T12	103,20	-	2.500.000	106,8019	26/12/23	26,6939	-	-	109,37	-	2.734.262	0,87	0,62
ARA GRUP TOPLAMI						66.252.000								58.226.460	18,58	13,13
Eurobond Türk																
	EXIMBANK	24/01/24	XS1917720911	7,48	-	745.000	104,3496	17/07/23	-	-	-	103,72	-	22.748.143	7,22	5,13
ARA GRUP TOPLAMI						745.000								22.748.143	7,22	5,13

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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 (%)
Özel Sektör																
Finansman Bonosu																
	HEKTS	05/01/24	TRFHEKT12411	41,50	-	6.300.000	82,8550	07/07/23	46,4937	-	-	99,58	-	6.273.694	2,00	1,41
	İŞ FAKTORİNG	05/01/24	TRFISFA12443	39,50	-	15.000.000	90,1470	26/09/23	45,4788	-	-	99,59	-	14.938.506	4,77	3,37
	VDF FİLO	05/04/24	TRFVDF42410	21,97	-	10.000.000	100,0000	10/10/23	53,2571	-	-	110,20	-	11.019.557	3,52	2,48
	SISE	24/09/24	TRFSISE92416	47,87	-	15.000.000	100,0000	26/09/23	53,2865	-	-	102,49	-	15.374.130	4,90	3,47
ARA GRUP TOPLAMI						46.300.000								47.605.887	15,19	10,73
Özel Sektör Tahvil																
	KOÇ FINANSMAN A.Ş	03/01/24	TRSKCTF12412	35,44	-	500.000	100,0000	01/12/22	32,0758	-	-	135,23	-	676.168	0,22	0,15
	KOÇ FINANSMAN A.Ş	11/01/24	TRSKCTF12420	35,17	-	650.000	100,0000	12/12/22	32,1147	-	-	134,14	-	871.927	0,28	0,20
	AEFES	18/01/24	TRSEFES12413	35,44	-	4.000.000	100,0000	22/12/22	32,6404	-	-	133,67	-	5.346.835	1,71	1,21
	AG ANADOLU GRUBU HOLDING A.Ş.	30/01/24	TRSYAZI12418	0,00	-	10.000.000	109,4069	18/05/23	30,5397	-	-	130,60	-	13.059.571	4,17	2,94
	VDF FİLO	06/02/24	TRSVDF22415	33,39	-	8.060.000	100,0000	27/01/23	32,3723	-	-	129,75	-	10.457.962	3,34	2,36
	VESTL	08/02/24	TRSVSTL22412	35,30	-	3.520.000	100,0000	25/01/23	33,8022	-	-	131,26	-	4.620.489	1,47	1,04
	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	15/02/24	TRSTTLK22413	33,84	-	7.000.000	100,0000	31/01/23	30,5574	-	-	129,51	-	9.065.528	2,89	2,04
	SELEC	20/02/24	TRSSLEC22414	35,02	-	10.000.000	100,0000	09/02/23	33,8454	-	-	129,74	-	12.973.892	4,14	2,92
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş	28/02/24	TRSENSA22414	35,35	-	17.000.000	100,0000	01/02/23	31,3892	-	-	129,60	-	22.032.594	7,03	4,97
	SETUR	31/10/24	TRSETRE2416	47,25	-	9.000.000	100,0000	24/10/23	54,4868	-	-	108,57	-	9.771.264	3,12	2,20
	ÇELİK MOTOR TİCARET A.Ş	10/01/25	TRSCLKM12514	46,79	-	5.500.000	100,0000	19/10/23	57,4952	-	-	109,84	-	6.041.036	1,93	1,36
	ENERJİSA ELEKTRİK	17/01/25	TRSENSA12514	32,96	-	1.000.000	100,0000	28/12/23	54,4054	-	-	108,43	-	1.084.297	0,35	0,24
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş	17/07/25	TRSENSA72526	42,38	-	12.000.000	100,0000	17/07/23	49,7648	-	-	108,89	-	13.067.006	4,17	2,95
	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	13/08/25	TRISGY82512	46,36	-	15.000.000	100,0000	22/11/23	56,0051	-	-	104,99	-	15.749.151	5,02	3,55
	CCOLA	01/10/25	TRSCOLAE2518	46,87	-	15.000.000	100,0000	28/09/23	55,9408	-	-	100,48	-	15.072.693	4,81	3,40
	AEFES	15/10/25	TRSEFESE2516	50,66	-	10.000.000	100,0000	10/10/23	55,9365	-	-	110,63	-	11.063.034	3,53	2,49
	KOÇ FINANSMAN A.Ş	20/10/25	TRSKCTFE2519	47,13	-	8.250.000	100,0000	16/10/23	52,4865	-	-	109,31	-	9.017.959	2,88	2,03
	OTKAR	20/10/25	TRSOTKRE2511	46,96	-	10.000.000	100,0000	18/10/23	52,4903	-	-	109,06	-	10.905.674	3,48	2,46

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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 (%)
Özel Sektör Tahvil																
	SİSE	04/11/25	TRSSISEK2519	49,69	-	7.880.000	100,0000	30/10/23	56,3269	-	-	108,98	-	8.587.820	2,74	1,94
ARA GRUP TOPLAMI						154.360.000								179.464.899	57,28	40,45
ARA GRUP TOPLAMI						200.660.000								227.070.786	72,47	51,18
GRUP TOPLAMI						267.657.000								308.045.389	98,27	69,44
T.REPO																
	HAZİNE	02/01/24	TRT180625T13	42,21	-	35.161.901	42,2100	29/12/23	-	8.978.375	35.161.901	43,57	-	35.120.053	100,00	7,92
GRUP TOPLAMI						35.161.901								35.120.053	100,00	7,92
MEVDUAT																
	AKBANK T.A.S.	02/01/24	-	11,00	-	16.040.000	-	29/12/23	-	-	16.059.336	11,00	-	16.054.500	100,00	3,62
GRUP TOPLAMI						16.040.000								16.054.500	100,00	3,62
DİĞER																
Y.Fonu Türk																
	AK3-AKPORTÖY	-	AK3-AK PORT. HİSSE SENEDİ FONU	-	-	599.483	20,0172	27/12/23	-	-	-	20,27	-	12.149.375	63,06	2,74
	AKPORTFOY	-	TAV-AK PORTFÖY AVIVASA EMEK. TEKNOLOJİ GSYF	-	-	1.743.626	1,7206	02/05/23	-	-	-	4,08	-	7.117.009	36,94	1,60
GRUP TOPLAMI						2.343.109								19.266.384	100,00	4,34

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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 (%)	
TÜREV																	
Futures																	
Uzun																	
		-	-	F_XU0300224	-	-	250	8.523,2500	29/12/23	-	-	-	8.523,25	-	21.308.125	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						250								21.308.125	0,00	0,00	
VIOP Nakit Teminatı																	
	VIOP Nakit Teminatı	-	-	-	-	19.005.434	-	-	-	-	-	-	-	19.005.434	100,00	4,72	
GRUP TOPLAMI						19.005.434								19.005.434	100,00	4,72	
DİĞER																	
Döviz																	
	FED	-	USD	-	-	1.398.241	28,8881	29/12/23	-	-	-	29,44	-	41.161.712	0,00	9,28	
GRUP TOPLAMI						1.398.241								41.161.712	0,00	9,28	
KİRA SERTİFİKALARI																	
Özel Sektör Kira Sertifikaları																	
	GARANTİ LESAİNG	11/11/25	TRDEMVKK2513	49,29	-	5.000.000	100,0000	24/10/23	55,1578	-	-	108,66	-	5.432.929	1,73	1,22	
GRUP TOPLAMI						5.000.000								5.432.929	1,73	1,22	
FON PORTFÖY DEĞERİ													402.924.750		100,00		

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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	402.924.750	-	90,82
B. HAZIR DEĞERLER	41.162.423	-	9,28
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	711	0,00	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	41.161.711,75	100,00	9,28
C. ALACAKLAR	-	-	-
a) Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-
i) T1 Alacakları	-	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	-	-	-
i) Diğer Alacaklar	-	-	-
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	-	-	-
D. BORÇLAR	(412.141)	-	(0,09)
a) Takasa Borçlar	-	-	0,00
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	-	-	-
b) Yönetim Ücreti	(376.329)	91,31	(0,08)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	0,00	-
e) DİĞER_BORÇLAR	(22.492)	8,69	(0,01)
i) Diğer Borçlar	(13.742,16)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(8.749,87)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(13.319,61)	3,23	(0,00)
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	443.675.032		100,00