

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN 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 AGRESİF DEĞİŞKEN 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 Agresif Değişken 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 AGRESİF DEĞİŞKEN 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 AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(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	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İskonto Oranı (%)	Repo Teminat Tutarı	Günlük Br Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ														
Hisse Türk														
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.		AKSA	-	-	85.091,00	83,083198	18/10/23	-	-	103,000000	8.764.373,00	3,33	2,86
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.		AKSEN	-	-	223.469,00	37,126064	18/10/23	-	-	29,740000	6.645.968,06	2,53	2,17
	ALBARAKA TÜRK KATILIM BANKASI A.Ş.		ALBRK	-	-	551.002,89	2,926921	18/10/23	-	-	3,820000	2.104.831,04	0,80	0,69
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.		ARDYZ	-	-	424.225,00	19,465336	18/10/23	-	-	26,080000	11.063.788,00	4,21	3,61
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ		ASELS	-	-	420.600,00	32,088892	18/10/23	-	-	44,980000	18.918.588,00	7,19	6,17
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ		ASELS	-	-	146.728,00	44,388122	28/12/23	-	-	44,980000	6.599.825,44	2,51	2,15
	BAŞKENT DOĞALGAZ DAĞITIM GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş. BASGZ		BASGZ	-	-	31.360,00	16,769201	18/10/23	-	-	18,710000	586.745,60	0,22	0,19
	BIOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN		BIOEN	-	-	493.505,00	18,491881	18/10/23	-	-	17,200000	8.488.286,00	3,23	2,77
	CW ENERJİ MÜHENDİSLİK TİCARET VE SANAYİ A.Ş.		CWENE	-	-	35.871,00	376,137780	18/10/23	-	-	271,250000	9.730.008,75	3,70	3,17
	DOĞANLAR MOBİLYA GRUBU İMALAT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		DGNMO	-	-	20.794,00	12,988190	18/10/23	-	-	9,370000	194.839,78	0,07	0,06
	DOĞUŞ OTOM.SERVİS VE TİC.A.Ş.		DOAS	-	-	20.170,00	243,972435	18/10/23	-	-	257,000000	5.183.690,00	1,97	1,69
	EBEBEK MAĞAZACILIK A.Ş.		EBEBK	-	-	128.000,00	69,701125	06/12/23	-	-	72,800000	9.318.400,00	3,54	3,04
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.		ENJSA	-	-	10,00	28,080000	03/05/23	-	-	45,540000	455,40	0,00	0,00
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.		EREGL	-	-	315.465,00	38,927112	27/11/23	-	-	41,000000	12.934.065,00	4,92	4,22
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.		EREGL	-	-	278.739,00	41,714619	28/12/23	-	-	41,000000	11.428.299,00	4,34	3,73
	GİRİŞİM ELEKTRİK SANAYİ TAAHHÜT VE TİCARET A.Ş.		GESAN	-	-	10,00	70,200000	03/05/23	-	-	66,600000	666,00	0,00	0,00
	GOODYEAR LASTİKLERİ T.A.Ş.		GOODY	-	-	51.402,00	18,294484	18/10/23	-	-	18,720000	962.245,44	0,37	0,31
	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.		GUBRF	-	-	12.330,00	231,947309	18/10/23	-	-	153,800000	1.896.354,00	0,72	0,62
	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.		ISDMR	-	-	10,00	33,120000	17/04/23	-	-	34,600000	346,00	0,00	0,00
	JANTSA JANT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		JANTS	-	-	11.076,65	114,694319	18/10/23	-	-	130,800000	1.448.825,82	0,55	0,47
	KALEKİM KİMYEVİ MADDELER SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		KLKİM	-	-	85.000,00	30,366882	25/10/23	-	-	21,500000	1.827.500,00	0,69	0,60
	KONYA KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		KONKA	-	-	88.117,00	48,146105	18/10/23	-	-	47,000000	4.141.499,00	1,57	1,35
	KONTROLMATİK TEKNOLOJİ ENERJİ VE MÜHENDİSLİK A.Ş.		KONTR	-	-	10,00	148,200000	17/04/23	-	-	217,000000	2.170,00	0,00	0,00
	KONYA KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		KONYA	-	-	10,00	976,200000	01/02/22	-	-	7.205,000000	72.050,00	0,03	0,02
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK		KRDMD	-	-	10,00	10,899000	10/10/22	-	-	23,760000	237,60	0,00	0,00
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK		KRDMD	-	-	1.048.300,00	23,400218	28/12/23	-	-	23,760000	24.907.608,00	9,51	8,10

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(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	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç Kısım Oranı (%)	Repo Teminat Tutarı	Günlük Br Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ														
Hisse Türk														
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		KRVGD	-	-	129.965,20	20,966967	18/10/23	-	-	20,980000	2.726.669,90	1,04	0,89
	LOKMAN HEKİM ENGÜRÜSAĞ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAHHÜT A.Ş.		LKMNH	-	-	61.949,00	38,635311	17/11/23	-	-	64,700000	4.008.100,30	1,52	1,31
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		MAVI	-	-	71.175,00	76,817481	18/10/23	-	-	116,500000	8.291.887,50	3,15	2,70
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.		MPARK	-	-	63.529,00	143,967418	18/10/23	-	-	149,000000	9.465.821,00	3,60	3,09
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.		MPARK	-	-	-25.001,00	143,967418	28/12/23	-	-	149,000000	-3.725.149,00	-1,42	-1,22
	ODAS ELEKTRİK ÜRETİM SAN.TİC.A.Ş.		ODAS	-	-	121.962,00	9,644902	18/10/23	-	-	8,250000	1.006.186,50	0,38	0,33
	PANELSAN ÇATI CEPHE SİSTEMLERİ SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		PNLSN	-	-	155.811,00	60,756914	06/11/23	-	-	56,400000	8.787.740,40	3,34	2,87
	SMART GÜNEŞ ENERJİSİ TEKNOLOJİLERİ ARAŞTIRMA GELİŞTİRME ÜRETİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		SMRTG	-	-	19,80	35,681818	28/07/23	-	-	55,250000	1,093,95	0,00	0,00
	SİNPAŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.		SNGYO	-	-	10,00	4,390000	05/10/22	-	-	2,730000	27,30	0,00	0,00
	SUN TEKSTİL SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		SUNTK	-	-	233.474,50	14,466732	06/11/23	-	-	19,600000	4.576.100,20	1,74	1,49
	SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.		SUWEN	-	-	318.791,00	14,215234	18/10/23	-	-	25,600000	8.186.552,88	3,11	2,67
	TÜRK HAVA YOLLARI A.Ö.		THYAO	-	-	76.317,50	213,434053	18/10/23	-	-	228,600000	17.446.180,50	6,63	5,69
	TÜRK HAVA YOLLARI A.Ö.		THYAO	-	-	-26.420,00	213,434053	28/12/23	-	-	228,600000	-6.039.612,00	-2,30	-1,97
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.		TKFEN	-	-	10,00	29,780000	03/05/23	-	-	36,920000	369,20	0,00	0,00
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFINERİ A.Ş.		TUPRS	-	-	137.399,00	96,827795	27/11/23	-	-	143,000000	19.648.057,00	7,47	6,41
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFINERİ A.Ş.		TUPRS	-	-	30.700,00	148,177280	28/12/23	-	-	143,000000	4.390.100,00	1,67	1,43
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		VESBE	-	-	411.646,95	15,345141	23/10/23	-	-	16,000000	6.586.351,20	2,50	2,15
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.		YATAS	-	-	137.100,00	30,333066	18/10/23	-	-	24,240000	3.323.303,98	1,26	1,08
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.		YATAS	-	-	-137.099,00	30,330330	28/12/23	-	-	24,240000	-3.323.279,76	-1,26	-1,08
	YAYLA AGRO GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		YYLGD	-	-	372.056,20	17,015226	18/10/23	-	-	12,770000	4.751.157,67	1,81	1,55
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.		BIMAS	-	-	80.417,00	194,231950	18/10/23	-	-	300,750000	24.185.412,75	9,19	7,89
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.		BIMAS	-	-	-45.201,00	194,231949	28/12/23	-	-	300,750000	-13.594.200,75	-5,17	-4,43
	ESCORT TEKNOLOJİ YATIRIM A.Ş.		ESCOM	-	-	136.426,00	33,018131	18/10/23	-	-	40,860000	5.574.366,36	2,12	1,82
	LOGO YAZILIM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		LOGO	-	-	109.664,00	70,005624	06/11/23	-	-	73,950000	8.109.652,80	3,08	2,65
	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.		SASA	-	-	39.230,51	53,429752	18/10/23	-	-	36,440000	1.429.559,82	0,54	0,47
GRUP TOPLAMI						6.925.238,20						263.834.114,63	100,00	85,78

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanım	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Iskonto Oranı (%)	Repo Teminat Tutarı	Günlük Br Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
KATILIM HESABI														
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	37,00	-	4.720.000,00	-	29/12/23	-	-	37,000000	4.739.138,63	33,34	1,55
	VAKİF KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	30,00	-	4.720.000,00	-	29/12/23	-	-	30,000000	4.735.517,81	33,31	1,54
	TÜRKİYE FİNANS KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	42,50	-	4.720.000,00	-	29/12/23	-	-	42,500000	4.741.983,56	33,35	1,55
GRUP TOPLAMI						14.160.000,00						14.216.640,00	100,00	4,64
DİĞER														
Borsa Y.Fonu Türk														
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KEF	-	-	52.134,00	62,926498	18/10/23	-	-	79,880000	4.164.463,92	14,19	1,36
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KPF	-	-	47.111,00	79,175696	18/10/23	-	-	110,809000	5.220.322,80	17,79	1,70
ARA GRUP TOPLAMI						99.245,00						9.384.786,72	31,98	3,06
Y.Fonu Türk														
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		HPV	-	-	728.220,00	2,123334	09/10/23	-	-	2,747786	2.000.992,72	6,82	0,65
	LETVEN CAPITAL GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		LDG	-	-	1.280.605,00	0,357755	21/02/22	-	-	1,591817	2.038.488,81	6,95	0,67
	ACTUS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		PYT	-	-	260.848,00	1,916818	22/12/21	-	-	9,056728	2.362.429,39	8,05	0,77
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		RTF	-	-	162,00	4.944,108395	18/03/22	-	-	10.136,204750	1.642.065,17	5,59	0,54
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		VFK	-	-	3.051.112,00	1,571207	23/08/23	-	-	1,917145	5.849.424,12	19,92	1,91
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		ZPF	-	-	42.169,00	5,454048	05/04/22	-	-	11,779504	496.729,90	1,69	0,16
	ZİRAAT BANKASI		ZPK	-	-	1.879.616,00	2,394104	09/10/23	-	-	2,966384	5.575.662,83	19,00	1,82
ARA GRUP TOPLAMI						7.342.732,00						19.965.792,94	68,82	6,52
GRUP TOPLAMI						7.341.977,00						29.350.579,66	100,00	9,58
FON PORTFÖY DEĞERİ												306.601.334,29		

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN 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		Toplam
	Tutar TL	Grup %	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	306.601.334,29	-	101,88
B. HAZIR DEĞERLER	56.503,76	-	0,02
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	56.503,76	100,00	0,02
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C. ALACAKLAR	44.556.382,16	-	14,81
a) Takastan Alacaklar Toplamı	44.507.134,99	100,00	14,79
i) T1 Alacakları	44.507.134,99	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	49.247,17	-	0,02
i) Diğer Alacaklar	49.247,17	-	0,02
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	-	-	-
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E. BORÇLAR	(50.264.964,91)	-	(16,70)
a) Takasa Borçlar	(47.219.997,74)	93,94	(15,69)
i) Takasa Borçlar T1	(47.219.997,74)	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(2.444.895,44)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(575.760,79)	1,15	(0,19)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Diğer Borçlar	(15.282,65)	0,05	(0,01)
i) Diğer Borçlar	(13.483,13)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(1.799,52)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(9.028,29)	0,02	-
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	300.949.255,30		100,00
Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000		
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	98.487.523.553,790		
Fon toplam değeri (TL)	300.949.255,30		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	1.512.476.446,210		
Birim pay değeri (TL)	0,198978		