

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

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

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN 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 Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oran	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
	AKBANK T.A.Ş.	-	AKBNK	-	-	10	19,0710	02/10/23	-	-	-	36,52	-	365	0,00	0,00
	ALBARAKA TURK KATILIM BANKASI A.Ş.	-	ALBRK	-	-	10	3,3600	10/08/23	-	-	-	3,82	-	38	0,00	0,00
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.	-	ARDYZ	-	-	895.000	21,8525	13/11/23	-	-	-	26,08	-	23.341.600	4,68	4,06
	BÜYÜK SEFLER GIDA TURİZM TEKSTİL DANISMANLIK ORGANIZASYON EĞİTİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	BIGCH	-	-	172.663	22,5206	12/12/23	-	-	-	22,84	-	3.943.623	0,79	0,69
	BİOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	699.272	17,2037	12/12/23	-	-	-	17,20	-	12.027.478	2,41	2,09
	Borlease Otomotiv Sanayi A.Ş	-	BORLS	-	-	85.000	188,8892	13/11/23	-	-	-	33,00	-	2.805.000	0,56	0,49
	DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU HOLD.A.Ş.	-	DOHOL	-	-	302.919	4,7314	20/12/23	-	-	-	11,06	-	3.350.284	0,67	0,58
	DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU HOLD.A.Ş.	-	DOHOL	-	-	35.000	11,0287	29/12/23	-	-	-	11,06	-	387.100	0,08	0,07
	EBEBEK MAĞAZACILIK A.Ş.	-	EBEBK	-	-	209.882	59,0750	18/12/23	-	-	-	72,80	-	15.279.410	3,07	2,66
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	1.190.000	41,7958	12/12/23	-	-	-	41,00	-	48.790.000	9,79	8,48
	FORD OTOMOTIV SANAYİ A.Ş.	-	FROTO	-	-	23.200	396,3067	14/06/23	-	-	-	739,50	-	17.156.400	3,44	2,98
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	GARAN	-	-	130.200	26,6002	12/06/23	-	-	-	58,35	-	7.597.170	1,52	1,32
	GEN İLAÇ VE SAĞLIK ÜRÜNLERİ SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	GENIL	-	-	190.150	22,9223	07/07/23	-	-	-	46,88	-	8.914.232	1,79	1,55
	GELECEK VARLIK YÖNETİMİ	-	GLCVY	-	-	428.299	34,2638	18/12/23	-	-	-	34,14	-	14.622.128	2,93	2,54
	TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.	-	ISCTR	-	-	10	5,2225	11/09/23	-	-	-	23,36	-	240	0,00	0,00
	İŞ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	-	ISMEN	-	-	698.765	9,2602	01/08/23	-	-	-	32,00	-	22.360.485	4,49	3,89
	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	-	KCHOL	-	-	365.798	90,0733	08/09/23	-	-	-	141,80	-	51.870.156	10,41	9,02
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	-	1.907.500	23,5836	07/12/23	-	-	-	23,76	-	45.322.200	9,09	7,88
	LOKMAN HEKİM ENGÜRÜSAĞ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAHHÜT A.Ş.	-	LKMNH	-	-	131.000	60,0851	20/12/23	-	-	-	64,70	-	8.475.700	1,70	1,47
	MİGROS TİC.A.Ş.	-	MGROS	-	-	128.617	173,3208	12/12/23	-	-	-	335,00	-	43.086.695	8,64	7,49
	Naturelgaz Sanayi ve Ticaret A.Ş.	-	NTGAZ	-	-	225.000	25,4868	20/12/23	-	-	-	23,10	-	5.197.500	1,04	0,90
	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.	-	PETKM	-	-	1.325.000	21,0275	11/09/23	-	-	-	18,21	-	24.128.250	4,84	4,20
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	31.220	517,9611	12/06/23	-	-	-	649,50	-	20.277.390	4,07	3,53
	SABANCI HOLDİNG A.Ş.	-	SAHOL	-	-	120.010	52,9999	13/10/23	-	-	-	60,45	-	7.254.605	1,46	1,26
	ŞEKERBANK T.A.Ş.	-	SKBNK	-	-	10	3,2000	10/08/23	-	-	-	4,30	-	43	0,00	0,00
	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş	-	SOKM	-	-	230.000	53,7021	17/10/23	-	-	-	53,95	-	12.408.500	2,49	2,16

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN 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 (%)
	SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.	-	SUWEN	-	-	603.868	5,9221	20/07/23	-	-	-	25,68	-	15.507.330	3,11	2,70
	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.	-	TCELL	-	-	280.000	54,6885	09/10/23	-	-	-	56,10	-	15.708.000	3,15	2,73
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	10	51,7010	19/10/23	-	-	-	228,60	-	2.286	0,00	0,00
	T.SINAI KALKINMA BANKASI A.Ş.	-	TSKB	-	-	10	6,2000	10/08/23	-	-	-	6,55	-	66	0,00	0,00
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	10	50,3160	11/10/23	-	-	-	143,00	-	1.430	0,00	0,00
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESBE	-	-	61.912	17,0741	12/12/23	-	-	-	16,00	-	990.592	0,20	0,17
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	-	YKBNK	-	-	10	13,4888	05/12/23	-	-	-	19,54	-	202	0,00	0,00
	ZİRAAT GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	-	ZRGYO	-	-	3.900.000	4,6000	19/12/23	-	-	-	5,67	-	22.113.000	4,44	3,85
	BATI EGE GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	-	BEGYO	-	-	500.000	3,0000	06/12/23	-	-	-	2,92	-	1.460.000	0,29	0,25
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	BIMAS	-	-	1.619	110,8526	19/12/23	-	-	-	300,75	-	486.914	0,10	0,08
	ESCORT TEKNOLOJİ YATIRIM A.Ş.	-	ESCOM	-	-	235.098	16,1241	13/07/23	-	-	-	40,86	-	9.606.104	1,93	1,67
	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	-	HALKB	-	-	10	13,9200	10/08/23	-	-	-	11,98	-	120	0,00	0,00
	İNDEKS BİLGİSAYAR SİSTEMLERİ MÜHENDİSLİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	INDES	-	-	1.773.301	3,3835	12/12/23	-	-	-	5,96	-	10.568.871	2,12	1,84
	Mega Metal Sanayi ve Ticaret A.Ş.	-	MEGMT	-	-	500	28,3000	12/12/23	-	-	-	22,32	-	11.160	0,00	0,00
	Sur Tatil Evleri Gayrimenkul Yatırım Ortaklığı A.Ş.	-	SURGY	-	-	425.000	49,1800	13/12/23	-	-	-	29,92	-	12.716.000	2,55	2,21
	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.	-	TAVHL	-	-	99.834	83,0643	28/12/23	-	-	-	107,50	-	10.732.155	2,15	1,87
	TEKNOSA İÇ VE DIŞ TİCARET A.Ş.	-	TKNSA	-	-	1	24,0400	11/10/23	-	-	-	29,70	-	30	0,00	0,00
	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O	-	VAKBN	-	-	10	12,3900	10/08/23	-	-	-	12,84	-	128	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						17.405.728								498.500.981	100,00	86,68
BORÇLANMA SENETLERİ																
Özel Sektör																
Finansman Bonosu																
	DEVA HOLDİNG A.Ş.	14/11/24	TRFDEVAK2415	46,87	-	6.000.000	100,0000	16/11/23	47,0264	-	-	105,09	-	6.305.307	27,58	1,10
ARA GRUP TOPLAMI						6.000.000								6.305.307	27,58	1,10

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN 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 Tahvil																
	İŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	03/11/25	TRSISGYK2519	47,43	-	15.410.000	100,0000	14/11/23	53,8487	-	-	105,95	-	16.327.461	71,42	2,84
	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O	14/09/29	TRSVKFB92925	19,91	-	210.000	104,5084	08/11/21	37,4721	-	-	108,43	-	227.710	1,00	0,04
ARA GRUP TOPLAMI						15.620.000								16.555.171	72,42	2,88
GRUP TOPLAMI						21.620.000								22.860.478	100,00	3,98
TPP																
	TPP	32/01/24	-	39,75	-	1.606.970	39,7500	29/12/23	-	-	1.606.970	42,59	-	1.606.970	100,00	0,28
GRUP TOPLAMI						1.606.970								1.606.970	100,00	0,28
DİĞER																
Borsa Y.Fonu Türk																
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZPLIBF	-	-	180.000	67,6383	09/10/23	-	-	-	96,24	-	17.323.200	42,50	3,01
ARA GRUP TOPLAMI						180.000								17.323.200	42,50	3,01
Y.Fonu Türk																
	LETVEN CAPITAL GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	LDG	-	-	1.043.869	0,3578	01/02/22	-	-	-	1,59	-	1.661.648	4,08	0,29
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	REB	-	-	1.800	1.000,0000	18/11/21	-	-	-	3.586,88	-	6.456.389	15,84	1,12
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	RP8	-	-	385.204	2,0768	27/12/21	-	-	-	8,35	-	3.218.144	7,89	0,56
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	RR8	-	-	3.500	1.000,0000	01/02/22	-	-	-	905,32	-	3.168.613	7,77	0,55
	24 GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	YD3	-	-	366.390	3,5482	11/03/22	-	-	-	10,24	-	3.750.897	9,20	0,65
	24 GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	YD7	-	-	995.700	1,5065	11/03/22	-	-	-	4,85	-	4.827.004	11,84	0,84
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZCD	-	-	222.375	1,1242	09/01/23	-	-	-	1,61	-	358.163	0,88	0,06
ARA GRUP TOPLAMI						3.018.838								23.440.859	57,50	4,07

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN 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 (%)	
GRUP TOPLAMI						3.198.838								40.764.059	100,00	7,08	
TÜREV																	
Futures																	
Uzun																	
		-	-	F_XU0301223	-	-	600	8.005,0000	14/11/23	-	-	-	8.025,75	-	48.154.500	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						600								48.154.500	0,00	0,00	
VIOP Nakit Teminatı																	
		-	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	16.605.823	-	-	-	-	-	-	16.605.823	100,00	2,86	
GRUP TOPLAMI						16.605.823								16.605.823	100,00	2,86	
FON PORTFÖY DEĞERİ														580.338.311		100,00	

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS 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		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	580.338.311	-	100,92
B. HAZIR DEĞERLER	96.532	-	0,02
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	96.532	100,00	0,02
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C. ALACAKLAR	227.803	-	0,04
a) Takastan Alacaklar Toplamı	161.926	100,00	0,03
i) T1 Alacakları	-	-	-
ii) T2 Alacakları	161.926	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	65.877	-	0,01
i) Diğer Alacaklar	23.370	-	0,00
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	42.507	-	0,01
D. BORÇLAR	(5.591.759)	-	(0,97)
a) Takasa Borçlar	(386.005)	6,90	(0,07)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	(386.005)	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(988.842,73)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(432.625)	7,74	(0,08)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	0,00	-
e) DİĞER BORÇLAR	(3.767.035)	67,68	(0,66)
i) Diğer Borçlar	(3.765.889,97)	-	(0,65)
ii) Denetim Reeskontu	(1.144,75)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(17.251,79)	0,31	(0,00)
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	575.070.886		100,00

Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	93.467.096.901,138
Fon toplam değeri (TL)	575.070.886,08
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	6.532.903.098,862
Birim pay değeri (TL)	0,088027