

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ KATILIM 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 DENGELİ KATILIM 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 Dengeli Katılım 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 DENGELİ KATILIM 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 DENGELİ KATILIM 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 (%)
HISSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	1.092	42,2972	26/07/23	-	-	-	103,00	-	112.476	0,44	0,18
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	AKSEN	-	-	9.926	41,0133	26/07/23	-	-	-	29,74	-	295.199	1,15	0,48
	ALBARAKA TÜRK KATILIM BANKASI A.Ş.	-	ALBRK	-	-	14.885	1,3945	26/07/23	-	-	-	3,82	-	56.860	0,22	0,09
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.	-	ARDYZ	-	-	55.800	19,6950	12/09/23	-	-	-	26,08	-	1.455.264	5,68	2,39
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ	-	ASELS	-	-	77.520	29,6888	29/08/23	-	-	-	44,98	-	3.486.850	13,64	5,72
	BİOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	65.776	18,1440	29/09/23	-	-	-	17,20	-	1.131.347	4,41	1,86
	BİOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	28.000	16,8987	28/12/23	-	-	-	17,20	-	481.600	1,88	0,79
	EBEBEK MAĞAZACILIK A.Ş.	-	EBEBK	-	-	15.000	69,5676	13/12/23	-	-	-	72,80	-	1.092.000	4,26	1,79
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.	-	ENJSA	-	-	10	27,9200	03/05/23	-	-	-	45,54	-	455	0,00	0,00
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	11.124	31,7987	26/07/23	-	-	-	41,00	-	456.084	1,78	0,75
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	57.500	41,7270	28/12/23	-	-	-	41,00	-	2.357.500	9,20	3,87
	FUZUL GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	-	FZLGY	-	-	100.000	8,9000	26/07/23	-	-	-	11,92	-	1.192.000	4,65	1,96
	GİRİŞİM ELEKTRİK SANAYİ TAAHHÜT VE TİCARET A.Ş.	-	GESAN	-	-	10	70,1000	03/05/23	-	-	-	66,60	-	666	0,00	0,00
	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	-	GUBRF	-	-	94	71,6904	06/10/22	-	-	-	153,80	-	14.457	0,06	0,02
	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	ISDMR	-	-	2.824	19,9231	26/07/23	-	-	-	34,60	-	97.710	0,38	0,16
	JANTSA JANT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	JANTS	-	-	353	69,8934	06/10/22	-	-	-	130,80	-	46.218	0,18	0,08
	KALESERAMİK ÇANAKKALE KALEBODUR SERAMİK SANAYİ A.Ş.	-	KLSEK	-	-	18.850	25,0000	26/07/23	-	-	-	64,35	-	1.212.998	4,73	1,99
	KONYA KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KONYA	-	-	10	1.019,1000	24/01/22	-	-	-	7.205,00	-	72.050	0,28	0,12
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	-	10	8,9940	10/10/22	-	-	-	23,76	-	238	0,00	0,00
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	18.413	18,6450	26/07/23	-	-	-	20,98	-	386.295	1,51	0,63
	LOKMAN HEKİM ENGÜRÜSAĞ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAHHÜT A.Ş.	-	LKMNH	-	-	14.665	31,3877	26/07/23	-	-	-	64,70	-	948.826	3,70	1,56
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	10.451	64,3711	25/09/23	-	-	-	116,50	-	1.217.542	4,75	2,00
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	-	MPARK	-	-	3.830	35,3527	26/07/23	-	-	-	149,00	-	570.670	2,23	0,94
	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN.TİC.A.Ş.	-	ODAS	-	-	11.073	7,5493	26/07/23	-	-	-	8,25	-	91.352	0,36	0,15
	Oyak Çimento Fabrikalar	-	OYAKC	-	-	8.387	16,6728	26/07/23	-	-	-	55,45	-	465.059	1,81	0,76
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	967	351,6085	26/07/23	-	-	-	649,50	-	628.067	2,45	1,03

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ KATILIM 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 Ük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
	PASİFİK GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	-	PSGYO	-	-	58	2,6467	06/09/23	-	-	-	4,99	-	288	0,00	0,00
	SMART GÜNEŞ ENERJİSİ TEKNOLOJİLERİ ARAŞTIRMA GELİŞTİRME ÜRETİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	SMRTG	-	-	20	35,5051	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	-	-	52.011	14,3686	06/11/23	-	-	-	25,68	-	1.335.642	5,21	2,19
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	8.095	42,2616	26/07/23	-	-	-	228,60	-	1.850.517	7,22	3,04
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	TKFEN	-	-	10	29,6200	03/05/23	-	-	-	36,92	-	369	0,00	0,00
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	19.646	92,0829	17/08/23	-	-	-	143,00	-	2.809.378	10,96	4,61
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESBE	-	-	14.148	7,4823	26/07/23	-	-	-	16,00	-	226.368	0,88	0,37
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.	-	YATAS	-	-	13.027	16,8978	26/07/23	-	-	-	24,24	-	315.774	1,23	0,52
	YAYLA AGRO GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	YYLGD	-	-	20.394	12,7794	15/08/23	-	-	-	12,77	-	260.433	1,02	0,43
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	BIMAS	-	-	10.431	111,3730	26/07/23	-	-	-	300,75	-	3.137.123	12,24	5,15
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	BIMAS	-	-	-8.750	111,3730	28/12/23	-	-	-	300,75	-	-2.631.563	(10,27)	(4,32)
	EGE GÜBRE SANAYİİ A.Ş.	-	EGGUB	-	-	100	22,0500	22/12/23	-	-	-	44,92	-	4.492	0,02	0,01
	LOGO YAZILIM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	LOGO	-	-	6.000	68,9173	06/11/23	-	-	-	73,95	-	443.700	1,73	0,73
	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.	-	SASA	-	-	46	11,1367	25/05/23	-	-	-	36,44	-	1.676	0,01	0,00
GRUP TOPLAMI						661.815								25.625.102	100,00	42,05
KATILIM HESABI																
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	37,00	-	2.550.000	-	29/12/23	-	-	2.560.340	37,00	-	2.560.340	50,02	4,20
	VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	30,00	-	2.550.000	-	29/12/23	-	-	2.558.384	30,00	-	2.558.384	49,98	4,20
GRUP TOPLAMI						5.100.000								5.118.723	100,00	8,40

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

OKS DENGELİ KATILIM 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 (%)
DİĞER																
Borsa Y.Fonu Türk																
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KEF	-	-	73.975	50,1219	10/10/23	-	-	-	79,88	-	5.909.123	26,60	9,70
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KPF	-	-	58.148	56,6263	10/10/23	-	-	-	110,81	-	6.443.322	29,02	10,58
ARA GRUP TOPLAMI						132.123								12.352.445	55,62	20,28
Y.Fonu Türk																
	LETVEN CAPITAL GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	LDG	-	-	1.254.951	0,3953	27/01/22	-	-	-	1,59	-	1.997.652	8,99	3,28
	ACTUS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	PYT	-	-	315.020	1,3650	24/09/21	-	-	-	9,06	-	2.853.050	12,84	4,68
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	RR2	-	-	378.690	1,3964	27/01/22	-	-	-	4,66	-	1.764.113	7,94	2,90
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş	-	RTF	-	-	203	1.000,0000	18/03/22	-	-	-	10.136,20	-	2.057.650	9,26	3,38
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZPF	-	-	100.842	5,4540	05/04/22	-	-	-	11,78	-	1.187.869	5,35	1,95
ARA GRUP TOPLAMI						2.049.706								9.860.334	44,38	16,19
GRUP TOPLAMI						2.181.829								22.212.779	100,00	36,47
KİRA SERTİFİKALARI																
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları																
	HAZINE	14/02/24	TRD140224T10	20,20	-	400.000	100,0000	16/02/22	16,6386	-	-	107,94	-	431.758	5,00	0,71
	HAZINE	20/03/24	TRD200324T29	24,30	-	1.400.000	100,0000	23/03/22	21,1663	-	-	107,64	-	1.506.984	17,44	2,47
	HAZINE	08/05/24	TRD080524T15	22,70	-	200.000	100,0000	11/05/22	15,7355	-	-	105,83	-	211.659	2,45	0,35
	HAZINE	21/08/24	TRD210824T15	0,00	-	1.660.000	101,6000	08/12/21	22,6104	-	-	100,43	-	1.667.206	19,30	2,74
	HAZINE	20/01/27	TRD200127T10	0,00	-	330.000	148,8737	15/03/22	(29,643239)	-	-	292,44	-	965.039	11,17	1,58
	HAZINE	16/02/28	TRD160228T14	9,28	-	3.000.000	100,0000	22/02/23	27,2098	-	-	63,27	-	1.897.966	21,98	3,12
	HAZINE	06/12/28	TRD061228T14	28,56	-	1.456.236	100,0000	13/12/23	27,3219	-	-	109,54	-	1.595.126	18,46	2,62
	HAZINE	04/08/32	TRD040832T16	16,14	-	400.000	100,0000	17/08/22	20,9984	-	-	90,74	-	362.946	4,20	0,60

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ KATILIM 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						8.846.236								8.638.683	100,00	14,19
FON PORTFÖY DEĞERİ														61.595.288		100,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ KATILIM 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	61.595.288	-	101,11
B. HAZIR DEĞERLER	55.786	-	0,09
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	55.786	100,00	0,09
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C. ALACAKLAR	2.731.079	-	4,48
a) Takastan Alacaklar Toplamı	2.731.079	100,00	4,48
i) T1 Alacakları	2.731.079,25	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	-	-	-
i) Diğer Alacaklar	-	-	-
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	-	-	-
D. BORÇLAR	(3.460.058)	-	(5,68)
a) Takasa Borçlar	(2.872.464)	83,02	(4,71)
i) Takasa Borçlar T1	(2.872.463,92)	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(121.505,78)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(45.241)	1,31	(0,07)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	0,00	-
e) DİĞER BORÇLAR	(419.020)	12,16	(0,69)
i) Diğer Borçlar	(417.220,94)	-	(0,68)
ii) Denetim Reeskontu	(1.799,26)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(1.827,66)	0,05	(0,00)
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	60.922.095		100,00

Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	98.792.197.019,589
Fon toplam değeri (TL)	60.922.094,69
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	1.207.802.980,411
Birim pay değeri (TL)	0,050440