

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş.
HEM Katılım Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2021 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
(eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş.
HEM Katılım Hisse Senedi Emeklilik Yatırım 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 (eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. HEM Katılım Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu”) (“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 2021 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.


Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 28 Nisan 2022

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. HEM Katılım Hisse Senedi
Emeklilik Yatırım 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
(Eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. HEM Katılım Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2021 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük				
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Değer/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	11,234.00	32.36	31/12/21	-	-	34.28	-	385,101.52	2.05	1.66
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	2,693.00	33.50	31/12/21	-	-	34.28	-	92,316.04	0.49	0.40
	ALKİM KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş	-	ALKİM	-	-	29,654.79	16.03	31/12/21	-	-	16.87	-	500,276.34	2.67	2.15
	ALKİM KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş	-	ALKİM	-	-	7,121.00	17.04	31/12/21	-	-	16.87	-	120,131.27	0.64	0.52
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.	-	ARDYZ	-	-	28,617.00	7.42	31/12/21	-	-	7.33	-	209,762.61	1.12	0.90
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.	-	ARDYZ	-	-	6,868.00	7.13	31/12/21	-	-	7.33	-	50,342.44	0.27	0.22
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARE	-	ASELS	-	-	39,214.00	19.79	31/12/21	-	-	20.88	-	818,788.32	4.37	3.52
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARE	-	ASELS	-	-	9,417.00	21.10	31/12/21	-	-	20.88	-	196,626.96	1.05	0.84
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş	-	BİMAS	-	-	24,834.00	69.42	31/12/21	-	-	61.30	-	1,522,324.20	8.12	6.55
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş	-	BİMAS	-	-	5,963.00	61.83	31/12/21	-	-	61.30	-	365,531.90	1.95	1.57
	BİLİCİ YATIRIM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	BLCYT	-	-	0.60	5.93	06/07/21	-	-	14.15	-	8.49	-	-
	COCO-COLA İÇEÇEK A.Ş	-	CCOLA	-	-	6,041.00	102.54	31/12/21	-	-	88.55	-	534,930.55	2.85	2.30
	COCO-COLA İÇEÇEK A.Ş	-	CCOLA	-	-	1,448.00	89.70	31/12/21	-	-	88.55	-	128,220.40	0.68	0.55
	ÇİMSA ÇİMENTO SAN.VE TİC.A.Ş.	-	CİMSA	-	-	5,530.00	31.08	31/12/21	-	-	30.80	-	170,324.00	0.91	0.73
	ÇİMSA ÇİMENTO SAN.VE TİC.A.Ş.	-	CİMSA	-	-	1,328.00	30.70	31/12/21	-	-	30.80	-	40,902.40	0.22	0.18
	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.	-	ENKAI	-	-	0.68	4.43	26/02/21	-	-	15.06	-	10.30	-	-
	ERBOSAN ERCİYAS BORU SANAYİİ VE TİC.	-	ERBOS	-	-	0.78	25.64	26/02/21	-	-	112.00	-	87.02	-	-
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	67,406.00	24.76	31/12/21	-	-	28.16	-	1,898,152.96	10.11	8.12
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	5,586.00	33.61	31/12/21	-	-	28.16	-	157,301.76	0.84	0.68
	GENTAŞ DEKORATİF YÜZEYLER SANAYİ V	-	GENTS	-	-	0.18	0.00	05/08/21	-	-	3.72	-	0.65	-	-
	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	-	GUBRF	-	-	12,251.00	60.89	31/12/21	-	-	76.85	-	941,489.35	5.02	4.05
	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	-	GUBRF	-	-	2,939.00	78.34	31/12/21	-	-	76.85	-	225,862.15	1.21	0.97
	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.	-	HEKTS	-	-	0.63	8.62	24/11/21	-	-	14.87	-	9.37	-	-
	HALK GAYRİMENKULYAT.ORT.A.Ş.	-	HLGYO	-	-	0.03	3.57	03/06/21	-	-	2.33	-	0.07	-	-
	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	ISDMR	-	-	23,690.00	13.47	31/12/21	-	-	23.24	-	550,555.60	2.94	2.37
	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	ISDMR	-	-	5,687.00	22.90	31/12/21	-	-	23.24	-	132,165.88	0.71	0.57
	JANTSA JANT SANAYİ VE TİCARET A.Ş	-	JANTS	-	-	2,264.65	83.10	31/12/21	-	-	65.00	-	147,202.25	0.79	0.63
	JANTSA JANT SANAYİ VE TİCARET A.Ş	-	JANTS	-	-	538.00	64.48	31/12/21	-	-	65.00	-	34,970.00	0.19	0.15
	KARTONSAN KARTON SAN.VE TİC.A.Ş.	-	KARTN	-	-	0.93	98.54	20/12/21	-	-	53.25	-	49.68	-	-
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	-	76,209.00	11.11	31/12/21	-	-	9.22	-	702,646.98	3.75	3.02
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	-	18,304.00	9.12	31/12/21	-	-	9.22	-	168,762.88	0.90	0.73
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	47,103.20	12.41	31/12/21	-	-	13.00	-	612,341.60	3.27	2.63

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. HEM Katılım Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2021 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük					
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Değer/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Değer	Kur	Değer	(%)	(%)	
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	11,305.00	12.00	31/12/21	-	-	13.00	-	146,965.00	0.78	0.63	
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	11,567.00	66.43	31/12/21	-	-	69.70	-	806,219.90	4.30	3.47	
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	2,776.00	67.55	31/12/21	-	-	69.70	-	193,487.20	1.03	0.83	
	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA A.Ş	-	OTKAR	-	-	929.00	358.07	31/12/21	-	-	355.00	-	329,795.00	1.76	1.42	
	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA A.Ş	-	OTKAR	-	-	220.00	350.01	31/12/21	-	-	355.00	-	78,100.00	0.42	0.34	
	OYAK ÇİMENTO FABRİKALARI A.Ş	-	OYAKC	-	-	51,397.00	6.94	31/12/21	-	-	7.90	-	406,036.30	2.17	1.75	
	OYAK ÇİMENTO FABRİKALARI A.Ş	-	OYAKC	-	-	12,342.00	7.72	31/12/21	-	-	7.90	-	97,501.80	0.52	0.42	
	PENTA TEKNOLOJİ ÜRÜNLERİ DAĞITIM TİC	-	PENTA	-	-	1,152.00	372.42	31/12/21	-	-	394.90	-	454,924.80	2.43	1.96	
	PENTA TEKNOLOJİ ÜRÜNLERİ DAĞITIM TİC	-	PENTA	-	-	1,300.00	381.81	31/12/21	-	-	394.90	-	513,370.00	2.74	2.21	
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	5,364.00	95.13	31/12/21	-	-	84.95	-	455,671.80	2.43	1.96	
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	1,286.00	84.94	31/12/21	-	-	84.95	-	109,245.70	0.58	0.47	
	TÜRK PRYSMIAN KABLO VE SİSTEMLERİ A	-	PRKAB	-	-	0.45	2.40	26/02/21	-	-	62.90	-	27.99	-	-	
	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş	-	SASA	-	-	19,892.11	42.86	31/12/21	-	-	52.85	-	1,051,298.07	5.61	4.52	
	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş	-	SASA	-	-	4,770.00	54.06	31/12/21	-	-	52.85	-	252,094.50	1.34	1.08	
	SELÇUK ECZA DEPOSU TİC.VE SAN.A.Ş.	-	SELEC	-	-	19,078.00	11.12	31/12/21	-	-	11.80	-	225,120.40	1.20	0.97	
	SELÇUK ECZA DEPOSU TİC.VE SAN.A.Ş.	-	SELEC	-	-	4,579.00	11.54	31/12/21	-	-	11.80	-	54,032.20	0.29	0.23	
	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	-	SISE	-	-	0.35	2.78	26/02/21	-	-	13.38	-	4.62	-	-	
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	40,123.50	16.76	31/12/21	-	-	20.02	-	803,272.47	4.29	3.45	
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	9,630.00	20.18	31/12/21	-	-	20.02	-	192,792.60	1.03	0.83	
	TEKFEN HOLDING A.Ş.	-	TKFEN	-	-	18,192.00	18.61	31/12/21	-	-	20.24	-	368,206.08	1.96	1.58	
	TEKFEN HOLDING A.Ş.	-	TKFEN	-	-	4,366.00	20.16	31/12/21	-	-	20.24	-	88,367.84	0.47	0.38	
	TÜRK TRAKTÖR VE ZİRAAT MAKİNELERİ A	-	TTRAK	-	-	1,996.00	187.02	28/12/21	-	-	224.00	-	447,104.00	2.39	1.92	
	TÜRK TRAKTÖR VE ZİRAAT MAKİNELERİ A	-	TTRAK	-	-	474.00	214.24	31/12/21	-	-	224.00	-	106,176.00	0.57	0.46	
	ASLAN ÇİMENTO A.Ş	-	TURGG	-	-	0.85	34.86	26/02/21	-	-	128.30	-	108.41	-	-	
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET	-	VESBE	-	-	24,496.95	5.16	31/12/21	-	-	7.88	-	193,035.97	1.03	0.83	
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET	-	VESBE	-	-	5,879.00	7.93	31/12/21	-	-	7.88	-	46,326.52	0.25	0.2	
	YATAS YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCAR	-	YATAS	-	-	44,713.00	12.84	31/12/21	-	-	11.12	-	497,208.55	2.65	2.14	
	YATAS YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCAR	-	YATAS	-	-	10,738.00	11.05	31/12/21	-	-	11.12	-	119,406.56	0.64	0.51	
GRUP TOPLAMI						750,511.66							18,743,096.22	100	80.57	
KATILIM HESABI																
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	03/01/22	-	14.25	-	700,000.00	-	31/12/21	-	-	14.25	-	700,819.86	60.87	3.01	
	VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	03/01/22	-	14.00	-	450,000.00	-	31/12/21	-	-	14.00	-	450,517.81	39.13	1.94	
GRUP TOPLAMI						1,150,000.00							1,151,337.67	100	4.95	

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. HEM Katılım Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2021 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Değer/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Değer	Kur	Değer	(%)	(%)
DİĞER															
Yatırım Fonu Türk															
	LETVEN CAPITAL	-	LDG	-	-	2,538,760.00	0.36	07/12/21	-	-	0.68	-	1,715,671.16	56.49	7.38
	ACTUS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	PYT	-	-	260,848.00	1.92	22/12/21	-	-	2.38	-	619,804.85	20.40	2.67
	ZİRAAT BANKASI	-	ZPK	-	-	366,861.00	1.91	24/12/21	-	-	1.91	-	702,097.11	23.11	3.02
GRUP TOPLAMI						3,166,469.00							3,037,573	100	13.07
KİRA SERTİFİKALARI															
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
	ALBARAKA TURK KATILIM B.	-	TRDBRKT22246	3.99	-	320,000.00	100.00	12/11/21	17.22	-	102.29	-	327,323.09	100.00	1.41
GRUP TOPLAMI						320,000.00							327,323	100	1.41
FON PORTFÖY DEĞERİ													23,259,330	100.00	

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş
KATILIM AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. HEM Katılım Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2021 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2021		Toplam %
	Tutar TL	Grup %	
A) FON PORTFÖY DEĞERİ	23,259,330.10	-	102.17
B) HAZIR DEĞERLER	47,932.36	-	0.21
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	47,932.36	100.00	0.21
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C) ALACAKLAR	3,634,517.36	-	15.97
a) Takastan Alacaklar Toplamı	3,619,966.71	100.00	
i) T1 Alacakları	2,453,536.48	-	-
ii) T2 Alacakları	1,166,430.23	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	14,550.65	-	0.06
i) Diğer Alacaklar	14,493.42	-	0.06
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	57.23	-	-
D) BORÇLAR	(4,176,518.64)	-	(18.35)
a) Takasa Borçlar	(3,963,831.13)	94.91	(17.41)
i) T1 Borçları	(2,540,080.68)	-	-
ii) T2 Borçları	(1,423,750.45)	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı Fon Pay Takas	(165,216.17)	3.96	(0.73)
b) Yönetim Ücreti	(43,314.06)	1.04	(0.19)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Diğer Borçlar	(3,474.35)	0.08	(0.02)
i) Diğer Borçlar	(1,114.83)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(2,359.52)	-	(0.01)
f) Kayda Alma Ücreti	(682.93)	0.02	-
g) Krediler	-	-	-
Fon toplam değeri	22,765,261.18		100.00

Toplam katılma payı/Pay sayısı	100,000,000,000
Yatırım fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	99,543,413,134
Fon toplam değeri (TL)	22,765,261.18
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	456,586,865.808
Birim pay değeri (TL)	0.04986