

**TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE
SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**31 ARALIK 2022 HESAP DÖNEMİNE AİT
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.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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. Sürdürülebilirlik Hisse Senedi 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 2022 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 Yüksekçaya, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 27 Nisan 2023

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ
EMEKLİLİK YATIRIM FONU

	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLAR	1-3
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	4

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Nominal		Faiz Ödeme Sayısı	Nominal		Birim Alış Fiyatı	Satın		İç Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük		Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
			Menkul Tanımı	Faiz Oranı		Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Tarihi		İskonto Oranı	Birir Deger			Günlük Kur				
HİSSE SENETLERİ																	
Hisse Türk																	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYİ A.Ş.	-	AEFES	-	-	202.545,00	24,32	15/12/22	-	-		-	67,75	-	13.722.423,75	0,85	0,84
	AKBANK	-	AKBNK	-	-	2.680.604,00	8,66	15/12/22	-	-		-	19,55	-	52.405.808,20	3,25	3,21
	AKFEN GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	-	AKFGY	-	-	621.760,00	3,70	15/12/22	-	-		-	5,28	-	3.282.892,80	0,20	0,20
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	115.320,00	34,51	15/12/22	-	-		-	91,95	-	10.603.674,00	0,66	0,65
	ARÇELİK A.Ş.	-	ARCLK	-	-	191.076,00	45,68	15/12/22	-	-		-	112,20	-	21.438.727,20	1,33	1,31
	ASELS	-	ASELS	-	-	517.620,00	20,19	15/12/22	-	-		-	62,15	-	32.170.083,00	1,99	1,97
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	448.891,00	79,82	15/12/22	-	-		-	136,90	-	61.453.177,90	3,81	3,76
	BİOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	1.807.041,00	6,79	21/12/22	-	-		-	18,95	-	34.243.426,95	2,12	2,10
	BİRİKİM VARLIK YÖNETİM A.Ş	-	BRKVY	-	-	6.544,00	14,20	14/12/22	-	-		-	35,46	-	232.050,24	0,01	0,01
	CCOLA	-	CCOLA	-	-	81.987,00	97,20	15/12/22	-	-		-	204,40	-	16.758.142,80	1,04	1,02
	DOĞANLAR MOBİLYA GRUBU İMALAT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	DGNMO	-	-	3.037.544,00	8,44	30/12/22	-	-		-	8,46	-	25.697.622,24	1,59	1,57
	DOĞANLAR MOBİLYA GRUBU İMALAT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	DGNMO	-	-	103.166,00	8,38	29/12/22	-	-		-	8,46	-	872.784,36	0,05	0,05
	DOĞUŞ OTOM.SERVİS VE TİC.A.Ş.	-	DOAS	-	-	342.996,00	140,00	29/12/22	-	-		-	196,00	-	67.227.216,00	4,17	4,11
	DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU HOLD.A.Ş.	-	DOHOL	-	-	1.372.367,00	3,97	15/12/22	-	-		-	10,58	-	14.519.642,86	0,90	0,89
	ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	-	ENJSA	-	-	138.684,00	17,46	15/12/22	-	-		-	36,06	-	5.000.945,04	0,31	0,31
	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.	-	ENKAI	-	-	805.925,39	20,48	15/12/22	-	-		-	33,14	-	26.708.367,42	1,66	1,63
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	1.685.361,00	25,90	15/12/22	-	-		-	41,26	-	69.537.994,86	4,31	4,26
	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	FROTO	-	-	70.043,00	273,30	15/12/22	-	-		-	524,50	-	36.737.553,50	2,28	2,25
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	GARAN	-	-	448.246,00	19,23	15/12/22	-	-		-	30,04	-	13.465.309,84	0,83	0,82
	İNDES	-	İNDES	-	-	153.125,00	12,94	15/12/22	-	-		-	20,92	-	3.203.375,00	0,20	0,20
	T.IS BANKASI	-	ISCTR	-	-	3.693.911,41	4,43	15/12/22	-	-		-	12,77	-	47.171.248,71	2,92	2,89
	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	ISDMR	-	-	116.788,00	24,58	15/12/22	-	-		-	33,30	-	3.889.040,40	0,24	0,24
	İŞBİR SENTETİK DOKUMA SANAYİ A.Ş.	-	ISSEN	-	-	141.000,00	28,56	26/08/22	-	-		-	86,00	-	12.126.000,00	0,75	0,74
	KOÇ HOLDING A.Ş.	-	KCHOL	-	-	747.831,00	35,32	15/12/22	-	-		-	83,70	-	62.593.454,70	3,88	3,83
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	-	572.721,00	11,54	15/12/22	-	-		-	17,99	-	10.303.250,79	0,64	0,63
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	368.890,00	26,66	29/12/22	-	-		-	30,00	-	11.066.700,00	0,69	0,68
	LDR TURİZM A.Ş.	-	LIDER	-	-	415.000,00	30,05	26/09/22	-	-		-	93,30	-	38.719.500,00	2,40	2,37
	LOGO	-	LOGO	-	-	39.907,00	48,04	15/12/22	-	-		-	69,75	-	2.783.513,25	0,17	0,17
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	217.001,00	45,09	15/12/22	-	-		-	132,20	-	28.687.532,20	1,78	1,75
	MİGROS TİC.A.Ş.	-	MGROS	-	-	501.867,00	100,42	15/12/22	-	-		-	146,50	-	73.523.515,50	4,56	4,50
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	-	MPARK	-	-	316.754,00	82,59	30/12/22	-	-		-	90,20	-	28.571.210,80	1,77	1,75
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	36.936,00	118,71	15/12/22	-	-		-	480,00	-	17.729.280,00	1,10	1,09
	SABANCI HOLDING A.Ş.	-	SAHOL	-	-	1.589.557,00	27,79	14/12/22	-	-		-	45,08	-	71.657.229,56	4,44	4,38

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 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 Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
SASA		-	SASA	-	-	1,84	16,72	09/05/22	-	-	110,00	-	202,40	-	-
TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.		-	SISE	-	-	1.210.317,69	14,76	15/12/22	-	-	42,92	-	51.946.835,25	3,22	3,18
SANICA ISI SANAYİ A.Ş.		-	SNICA	-	-	194.979,00	20,03	15/12/22	-	-	30,66	-	5.978.056,14	0,37	0,37
ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.		-	SOKM	-	-	465.322,00	15,96	15/12/22	-	-	27,96	-	13.010.403,12	0,81	0,80
SUN TEKSTİL SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		-	SUNTK	-	-	187.578,00	58,42	26/12/22	-	-	59,10	-	11.085.859,80	0,69	0,68
SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.		-	SUWEN	-	-	941.020,00	30,92	29/12/22	-	-	75,00	-	70.576.500,00	4,38	4,32
SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.		-	SUWEN	-	-	6.500,00	70,41	29/12/22	-	-	75,00	-	487.500,00	0,03	0,03
TAV		-	TAVHL	-	-	196.781,00	42,38	15/12/22	-	-	93,50	-	18.399.023,50	1,14	1,13
TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.		-	TCELL	-	-	1.746.733,00	17,82	23/12/22	-	-	37,88	-	66.166.246,04	4,10	4,05
TÜRK HAVA YOLLARI A.O.		-	THYAO	-	-	922.695,00	53,49	15/12/22	-	-	140,90	-	130.007.725,50	8,07	7,93
TEKFEN HOLDING A.Ş.		-	TKFEN	-	-	643.654,00	28,73	15/12/22	-	-	49,26	-	31.706.396,04	1,97	1,94
TOASO		-	TOASO	-	-	193.911,00	78,93	15/12/22	-	-	165,70	-	32.131.052,70	1,99	1,97
TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.		-	TTKOM	-	-	617.024,00	7,99	15/12/22	-	-	24,56	-	15.154.109,44	0,94	0,93
TURK TRAKTOR VE ZIRAAT MAKİNELERİ A.S.		-	TTRAK	-	-	6.377,00	241,59	15/12/22	-	-	660,00	-	4.208.820,00	0,26	0,26
TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.		-	TUPRS	-	-	201.142,00	251,88	15/12/22	-	-	529,90	-	106.585.145,80	6,61	6,52
VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET A.S.		-	VESBE	-	-	657.372,88	5,99	15/12/22	-	-	13,78	-	9.058.598,29	0,56	0,55
VESTL		-	VESTL	-	-	1.026.405,00	42,90	26/12/22	-	-	71,25	-	73.131.356,25	4,53	4,47
YATAS		-	YATAS	-	-	377.551,00	13,65	15/12/22	-	-	33,86	-	12.783.876,86	0,79	0,78
YAPI KREDİ BANK		-	YKBNK	-	-	2.932.744,00	3,74	15/12/22	-	-	11,81	-	34.635.706,64	2,15	2,12
ZİRAAT GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.		-	ZRGYO	-	-	1.392.058,00	1,60	23/11/22	-	-	5,72	-	7.962.571,76	0,49	0,49
GRUP TOPLAMI						37.509.175,21							1.613.118.679,40	100,00	98,70
TPP															
TPP		02/01/23	-	10,80	-	12.611.184,66	10,80	30/12/22	-	-	11,35	-	12.611.184,66	100,00	0,77
GRUP TOPLAMI						12.611.184,66							12.611.184,66	100,00	0,77
DİĞER															
Yatırım Fonu Türk															
ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		-	HLL	-	-	54.244.000,00	0,09	30/12/22	-	-	0,09	-	4.999.994,94	72,45	0,31
ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		-	ZJL	-	-	400.200,00	1,00	13/08/21	-	-	4,75	-	1.900.946,00	27,55	0,12
GRUP TOPLAMI						54.644.200,00							6.900.940,94	100,00	0,43

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

			Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük					
Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutar	Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
VIOP NAKİT TEMİNATI															
	VIOP Nakit Teminatı	-	-	-	-	1.640.440,59	-	-	-	-	-	-	1.640.440,59	100,00	0,10
GRUP TOPLAMI						1.640.440,59							1.640.440,59	100,00	0,10
FON PORTFÖY DEĞERİ													1.634.271.245,59		100,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU (Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2022		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A)FON PORTFÖY DEĞERİ	1.634.271.245,59	-	100,37
B)HAZIR DEĞERLER	78.543,31	-	0,00
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	78.543,31	100,00	0,00
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C)ALACAKLAR	-	-	-
a) Takastan Alacaklar	-	-	-
i) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	-	-	-
i) Diğer Alacaklar	-	-	-
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
D)BORÇLAR	(6.116.729,16)	-	(0,38)
a) Takasa Borçlar	(1.322.509,24)	21,62	(0,08)
i) Takasa Borçlar T1	(1.322.509,24)	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(1.999.801,65)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(2.739.897,94)	44,79	(0,17)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Diğer Borçlar	(5.673,34)	0,89	-
i) Diğer Borçlar	(2.723,24)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(2.950,10)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(48.846,99)	0,80	0,00
g) Krediler	-	-	-
Fon toplam değeri	1.628.233.059,74		100,00

Toplam katılma payı/Pay sayısı	500.000.000.000,00
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	484.629.139.124,71
Fon toplam değeri (TL)	1.628.233.059,74
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	15.370.860.875,30
Birim pay değeri (TL)	0,105930