

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM DİNAMİK 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 DİNAMİK 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 Dinamik 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 DİNAMİK DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
İÇİNDEKİLER

SAYFA

I-	FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-2
II-	TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	3

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

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI
(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

Mevduat Kaynak	Birleşik Kurum	Vade Tarihi	Mevduat Tutarı	Nominal Fiyat Oranı	Fiyat Ödeme Seyri	Nominal Değer	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İstisna Oranı (%)	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Bk Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	46.222,00	82,001929	18/10/23	-	-	-	103,000000	4.760.866,00	3,45	2,91
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	AKSEN	-	-	114.753,00	40,197494	18/10/23	-	-	-	29,740000	3.412.754,22	2,47	2,08
	ALBARAKA TÜRK KATILIM BANKASI A.Ş.	-	ALBRK	-	-	260.670,85	2,537772	18/10/23	-	-	-	3,820000	995.762,65	0,72	0,61
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.	-	ARDVZ	-	-	205.109,00	19,680723	18/10/23	-	-	-	26,080000	5.349.242,72	3,88	3,27
	AŞEL SAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ	-	AŞELS	-	-	269.874,00	30,599415	18/10/23	-	-	-	44,980000	12.138.932,52	8,81	7,39
	AŞEL SAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ	-	AŞELS	-	-	41.984,00	45,155229	28/12/23	-	-	-	44,980000	1.888.440,32	1,37	1,15
	BASKENT DOĞALGAZ DAĞITIM GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş. BASKZ	-	BASKZ	-	-	11.883,00	15,550664	18/10/23	-	-	-	18,710000	222.330,93	0,16	0,14
	BİOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BİOEN	-	BİOEN	-	-	219.984,00	17,482619	18/10/23	-	-	-	17,200000	3.783.724,80	2,74	2,31
	CW ENERJİ MÜHENDİSLİK TİCARET VE SANAYİ A.Ş.	-	CWENE	-	-	17.379,00	373,081483	18/10/23	-	-	-	271,250000	4.714.053,75	3,42	2,88
	DOĞUŞ OTOMOTİV SERVİS VE TİC.A.Ş.	-	DOAS	-	-	9.626,00	235,135149	18/10/23	-	-	-	257,000000	2.471.882,00	1,79	1,51
	EBEBEK MAĞAZACILIK A.Ş.	-	EBEBK	-	-	71.000,00	69,577711	06/12/23	-	-	-	72,800000	5.168.800,00	3,75	3,16
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.	-	ENISA	-	-	10,00	28,080000	03/05/23	-	-	-	45,540000	455,40	0,00	0,00
	ERİĞLİ DEMİR VE ÇELİK F.A.Ş.	-	ERİGL	-	-	164.296,00	36,751527	27/11/23	-	-	-	41,000000	6.732.440,00	4,98	4,11
	ERİĞLİ DEMİR VE ÇELİK F.A.Ş.	-	ERİGL	-	-	163.822,00	41,686504	28/12/23	-	-	-	41,000000	6.634.702,00	4,81	4,05
	GRİŞİM ELEKTRİK SANAYİ TAAHHÜT VE TİCARET A.Ş.	-	GESAN	-	-	10,00	70,250000	03/05/23	-	-	-	66,600000	666,00	0,00	0,00
	GOODYEAR LASTİKLERİ T.A.Ş.	-	GOODY	-	-	27.645,00	15,283801	18/10/23	-	-	-	18,720000	517.514,40	0,38	0,32
	GÖBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	-	GLBRF	-	-	5.956,00	183,002522	18/10/23	-	-	-	153,800000	916.032,80	0,66	0,56
	İSKİNDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	İSDMR	-	-	24.106,00	24,530825	18/10/23	-	-	-	34,600000	834.067,60	0,60	0,51
	JANTSA JANT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	JANTS	-	-	6.169,00	103,860537	18/10/23	-	-	-	130,800000	806.905,20	0,58	0,49
	KONYA KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KONYA	-	-	10,00	1.002,900000	25/01/22	-	-	-	7,20510000	72.050,00	0,05	0,04
	KARDEMİR KARAHÖK DEM ÇELİK	-	KRDMD	-	-	213.685,00	23,321275	29/12/23	-	-	-	23,760000	5.077.155,60	3,68	3,10
	KARDEMİR KARAHÖK DEM ÇELİK	-	KRDMD	-	-	364.000,00	23,458745	28/12/23	-	-	-	23,760000	8.648.640,00	6,27	5,28
	KIRVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	66.203,12	18,751902	18/10/23	-	-	-	20,980000	1.388.941,46	1,01	0,85
	LORKMAN HEKİM ENJENYERİ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAHHÜT A.Ş.	-	LKMHM	-	-	60.539,00	36,751172	17/11/23	-	-	-	64,700000	3.916.873,30	2,84	2,39
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	44.273,00	66,207072	18/10/23	-	-	-	116,500000	5.157.804,50	3,74	3,15
	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN.TİC.A.Ş.	-	ODAS	-	-	51.673,00	9,199330	18/10/23	-	-	-	8,250000	426.302,25	0,31	0,26
	PGSASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	5.912,00	472,102004	18/10/23	-	-	-	649,500000	3.629.844,00	2,78	2,35
	PANELSAN GATI ÇEPIRE SİSTEMLERİ SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	PNLVN	-	-	64.771,00	60,868897	18/10/23	-	-	-	56,400000	3.623.094,40	2,65	2,23
	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.	-	SNQYO	-	-	10,00	4,390000	05/10/22	-	-	-	2,730000	27,30	0,00	0,00
	SUN TEKSTİL SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	SUNTK	-	-	134.053,50	13,492873	06/11/23	-	-	-	19,600000	2.627.448,60	1,90	1,60
	SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.	-	SUWEN	-	-	203.898,00	14,699781	06/11/23	-	-	-	25,680000	5.236.100,64	3,80	3,20
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	36.474,00	111,280450	18/10/23	-	-	-	228,600000	8.337.956,40	6,04	5,09
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	-13.180,00	111,280451	28/12/23	-	-	-	228,600000	-3.012.948,00	-2,18	-1,84
	TEKFEH HOLDİNG A.Ş.	-	TKFEN	-	-	10,00	29,780000	03/05/23	-	-	-	36,520000	369,20	0,00	0,00
	TÖPKAS TÜRKİYE PETROL RAFFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	71.161,00	78,027293	27/11/23	-	-	-	143,000000	10.176.023,00	7,38	6,22
	TÖPKAS TÜRKİYE PETROL RAFFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	20.968,00	147,700000	28/12/23	-	-	-	143,000000	2.998.424,00	2,17	1,83
	VESTEL BEYAZ EŞYA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	VESBE	-	-	108.511,16	10,599259	18/10/23	-	-	-	16,000000	1.736.178,56	1,26	1,06
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.	-	YATAS	-	-	61.202,00	25,094136	18/10/23	-	-	-	24,240000	1.483.536,48	1,08	0,91
	YAYLA AGRO GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	YYLGD	-	-	192.885,30	16,052142	18/10/23	-	-	-	12,770000	2.463.145,28	1,79	1,50
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	BIMAS	-	-	37.119,00	153,642679	18/10/23	-	-	-	300,750000	11.163.539,25	8,09	6,82
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	BIMAS	-	-	-24.150,00	153,642679	28/12/23	-	-	-	300,750000	-7.263.112,50	-5,27	-4,44
	ESCORT TEKNOLOJİ YATIRIM A.Ş.	-	ESCOM	-	-	120.155,00	31,581112	18/10/23	-	-	-	40,860000	4.909.533,30	3,56	3,00
	LOGO YAZILIM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	LOGO	-	-	40.055,00	69,685209	06/11/23	-	-	-	73,950000	3.553.667,25	2,58	2,17
	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.	-	SASA	-	-	23,00	10,826522	25/05/23	-	-	-	36,440000	838,12	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						3.528.689,73							137.944.095,65	100,00	84,22
KATILIM HESABI															
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	37,00	-	3.500.000,00	-	29/12/23	-	-	3.514.191,78	37,000000	3.514.191,78	33,34	2,15
	VAKIF KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	30,00	-	3.500.000,00	-	29/12/23	-	-	3.511.506,85	30,000000	3.511.506,85	33,31	2,15
	TÜRKİYE FİNANS KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	42,50	-	3.500.000,00	-	29/12/23	-	-	3.516.301,37	42,500000	3.516.301,37	33,35	2,15
GRUP TOPLAMI						10.500.000,00							10.542.000,00	100,00	6,45
DİĞER															
Borsa Yabancı Türk															
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZİRKPF	-	-	27.776,00	47,930212	18/10/23	-	-	-	79,880000	2.218.746,88	15,86	1,35
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZİRKPF	-	-	23.451,00	98,517236	18/10/23	-	-	-	110,809000	2.598.381,86	18,57	1,59
ARA GRUP TOPLAMI						51.227,00							4.817.328,74	34,43	2,94

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

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul Kaynak	Braçer Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanım	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç Hesap Oranı (%)	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Br Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
Y.Fonu Türk															
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	HPV	-	-	766.838,00	2,123103	16/02/23	-	-	-	2,747786	2.107.106,72	15,06	1,29
	LETİVEN CAPITAL GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	LDG	-	-	1.940.628,00	0,357755	25/02/22	-	-	-	1,591817	3.089.124,64	22,08	1,89
	RE-PE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	RR2	-	-	552.526,00	1,396445	25/02/22	-	-	-	4,658463	2.573.921,93	18,40	1,57
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZPF	-	-	119.176,00	5,454048	05/04/22	-	-	-	11,779504	1.403.634,17	10,03	0,86
ARA GRUP TOPLAMI						3.379.168,00							9.173.987,46	65,57	5,61
GRUP TOPLAMI						3.430.395,00							13.991.316,20	100,00	8,55
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
	HAZINE	14/02/24	TRD140224T10	20,20	-	360.000,00	100,000000	16/02/22	16,638589	-	-	107,939458	388.582,05	30,70	0,24
	HAZINE	08/05/24	TRD080524T15	22,70	-	400.000,00	100,000000	11/05/22	15,735485	-	-	105,829646	423.318,59	33,45	0,26
	HAZINE	04/08/32	TRD040832T16	16,14	-	500.000,00	100,000000	17/08/22	20,998357	-	-	90,736377	453.681,89	35,85	0,28
ARA GRUP TOPLAMI						1.260.000,00							1.265.582,53	100,00	0,78
FON PORTFÖY DEĞERİ													163.742.994,38		

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM DİNAMİK 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	163.742.994,38	-	102,79
B. HAZIR DEĞERLER	56.759,89	-	0,04
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	56.759,89	100,00	0,04
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C. ALACAKLAR	20.297.696,33	-	12,74
a) Takastan Alacaklar Toplamı	20.191.261,53	100,00	12,68
i) T1 Alacakları	20.191.261,53	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	106.434,80	-	0,07
i) Diğer Alacaklar	106.434,80	-	0,07
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettu	-	-	-
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E. BORÇLAR	(24.804.807,30)	-	(15,57)
a) Takasa Borçlar	(20.277.547,52)	81,75	(0,20)
i) Takasa Borçlar T1	(20.277.547,52)	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(4.200.932,01)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(313.800,87)	1,27	(0,20)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Diğer Borçlar	(7.748,25)	0,05	-
i) Diğer Borçlar	(5.948,48)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(1.799,77)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(4.778,65)	0,02	-
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	159.292.643,30		100,00
Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000		
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	98.779.166.829,878		
Fon toplam değeri (TL)	159.292.643,30		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	1.220.833.170,122		
Birim pay değeri (TL)	0,130479		