

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

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI
(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	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Iskonto Oranı (%)	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ														
Hisse Türk														
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	137.901,00	41,221133	17/10/22	-	-	103,000000	14.203.803,00	1,24	0,99
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	AKSEN	-	-	398.007,00	34,362087	09/10/23	-	-	29,740000	11.836.728,18	1,04	0,83
	ALBARAKA TURK KATILIM BANKASI A.S.	-	ALBRK	-	-	11.401.100,47	3,696577	24/10/23	-	-	3,820000	43.552.203,80	3,82	3,04
	ARD GRUP BİLİŞİM TEKNOLOJİLERİ A.Ş.	-	ARDYZ	-	-	1.420.000,00	19,505089	23/10/23	-	-	26,080000	37.033.600,00	3,24	2,59
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ	-	ASELS	-	-	1.927.016,00	24,236657	15/12/23	-	-	44,980000	86.677.179,68	7,59	6,05
	BIOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	1.071.387,00	17,921559	11/12/23	-	-	17,200000	18.427.856,40	1,61	1,29
	BIOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	160.000,00	17,005391	29/12/23	-	-	17,200000	2.752.000,00	0,24	0,19
	Borçane Otomotiv Sanayi A.Ş	-	BORLS	-	-	678.261,00	36,557106	19/12/23	-	-	33,000000	22.382.613,00	1,96	1,56
	DOĞANLAR MOBİLYA GRUBU İMALAT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	DGNMO	-	-	1.398.688,00	8,473114	13/12/23	-	-	9,370000	13.105.706,56	1,15	0,92
	DOĞUŞ OTOM.SERVİS VE TİC.A.Ş.	-	DOAS	-	-	104.000,00	217,239494	13/11/23	-	-	257,000000	26.728.000,00	2,34	1,87
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.	-	ENISA	-	-	230.010,00	55,291982	24/10/23	-	-	45,540000	10.474.655,40	0,92	0,73
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	ERELG	-	-	1.370.000,00	32,006875	30/11/23	-	-	41,000000	56.170.000,00	4,92	3,92
	GİRİŞİM ELEKTRİK SANAYİ TAAAHHÜT VE TİCARET A.Ş	-	GESAN	-	-	10,00	68,750000	03/05/23	-	-	66,600000	666,00	0,00	0,00
	GOODYEAR LASTİKLERİ T.A.Ş.	-	GOODY	-	-	814.943,00	16,977459	28/12/22	-	-	18,720000	15.255.732,96	1,34	1,07
	GRAINTURK TARIM A.Ş.	-	GRTRK	-	-	21,00	17,600000	25/04/23	-	-	41,240000	866,04	0,00	0,00
	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	-	GUBRF	-	-	56.354,00	78,327878	18/12/23	-	-	153,800000	8.667.245,20	0,76	0,60
	İSKENDERUN DEMİR ÇELİK A.Ş.	-	ISDMR	-	-	10,00	18,817000	03/03/23	-	-	34,600000	346,00	0,00	0,00
	KONTROLMATİK TEKNOLOJİ ENERJİ VE MÜHENDİSLİK A.Ş	-	KONTR	-	-	20,00	136,300000	06/04/23	-	-	217,000000	4.340,00	0,00	0,00
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMĐ	-	-	1.965.006,00	20,171125	15/12/23	-	-	23,760000	46.688.542,56	4,09	3,26
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	277.093,16	14,567349	14/12/23	-	-	20,980000	5.813.414,50	0,51	0,41
	LOKMAN HEKİM ENGÜRÜSAĞ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAAHHÜT A.Ş.	-	LKMNH	-	-	190.885,00	50,001907	28/12/23	-	-	64,700000	12.350.259,50	1,08	0,86
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVİ	-	-	541.000,00	36,288185	13/10/23	-	-	116,500000	63.026.500,00	5,52	4,40
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	-	MPARK	-	-	285.587,00	41,344999	30/11/23	-	-	149,000000	42.552.463,00	3,73	2,97
	Naturelgaz Sanayi ve Ticaret A.Ş.	-	NTGAZ	-	-	942.675,00	16,711386	29/12/23	-	-	23,100000	21.775.792,50	1,91	1,52
	Naturelgaz Sanayi ve Ticaret A.Ş.	-	NTGAZ	-	-	110.000,00	21,960909	29/12/23	-	-	23,100000	2.541.000,00	0,22	0,18
	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN.TİC.A.Ş.	-	ODAS	-	-	10,00	7,250000	10/10/22	-	-	8,250000	82,50	0,00	0,00
	Oyak Çimento Fabrikaları	-	OYAKC	-	-	503.583,00	16,887623	30/11/23	-	-	55,450000	27.923.677,35	2,45	1,95
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	44.464,00	240,454644	13/11/23	-	-	649,500000	28.879.368,00	2,53	2,02
	PANELSAN ÇATI CEPHE SİSTEMLERİ SANAYİ VE TİCARET A.Ş	-	PNLSN	-	-	58.483,00	62,814226	13/10/23	-	-	56,400000	3.298.441,20	0,29	0,23
	PASİFİK GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş	-	PSGYO	-	-	16,00	2,690625	06/09/23	-	-	4,990000	79,84	0,00	0,00
	SELÇUK ECZA DEPOSU TİC.VE SAN.A.Ş.	-	SELEC	-	-	325.000,00	41,717120	26/07/23	-	-	61,600000	20.020.000,00	1,75	1,40
	SMART GÜNEŞ ENERJİSİ TEKNOLOJİLERİ ARAŞTIRMA GELİŞTİRME ÜRETİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	SMRTG	-	-	19,80	35,404040	28/07/23	-	-	55,250000	1.093,95	0,00	0,00
	SİNPAŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	-	SNGYO	-	-	10,00	4,350000	10/10/22	-	-	2,730000	27,30	0,00	0,00
	SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.	-	SUWEN	-	-	706.552,00	7,705441	15/12/23	-	-	25,680000	18.144.255,36	1,59	1,27
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	513.697,00	59,277364	15/12/23	-	-	228,600000	117.431.134,20	10,29	8,20
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	TKFEN	-	-	332.050,00	43,442548	12/12/23	-	-	36,920000	12.259.286,00	1,07	0,86
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	808.259,00	61,421914	13/11/23	-	-	143,000000	115.581.037,00	10,13	8,07
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESBE	-	-	1.062.463,00	8,897363	25/10/23	-	-	16,000000	16.999.408,00	1,49	1,19
	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESTL	-	-	485.000,00	65,792498	01/12/23	-	-	46,240000	22.426.400,00	1,96	1,57
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.	-	YATAS	-	-	657.337,50	13,475922	17/10/22	-	-	24,240000	15.933.860,98	1,40	1,11
	YAYLA AGRO GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	YYLGD	-	-	905.000,00	15,159000	05/12/23	-	-	12,770000	11.556.850,00	1,01	0,81
	AKÇANSA ÇİMENTO SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	AKCNS	-	-	220.299,00	24,335463	27/12/23	-	-	142,300000	31.348.547,70	2,75	2,19
	ALKİM ALKALİ KİMYA A.Ş	-	ALKİM	-	-	239.419,16	18,932846	17/10/22	-	-	34,080000	8.159.404,90	0,71	0,57
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş	-	BİMAS	-	-	430.000,00	117,210826	18/10/23	-	-	300,750000	129.322.500,00	11,35	9,03
	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş	-	SASA	-	-	23,59	15,307386	25/05/23	-	-	36,440000	859,47	0,00	0,00
ARA GRUP TOPLAMI						32.771.660,67						1.141.307.828,03	100,00	79,72

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

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(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	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı (%)	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
KATILIM HESABI														
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	02/01/24	-	37,00	-	49.860.000,00	-	29/12/23	-	-	37,000000	50.062.172,05	45,24	3,50
	Türkiye Enlak Katılım Bankası	03/01/24	-	41,00	-	19.343.288,21	-	23/11/23	-	-	41,000000	20.212.411,30	18,27	1,41
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	04/01/24	-	40,50	-	19.010.620,28	-	28/11/23	-	-	40,500000	19.748.909,44	17,85	1,38
	Türkiye Enlak Katılım Bankası	12/01/24	-	42,00	-	20.000.000,00	-	06/12/23	-	-	42,000000	20.621.369,86	18,64	1,44
ARA GRUP TOPLAMI						108.213.908,49						110.644.862,65	100,00	7,73
DİĞER														
Borsa Y.Fonu Türk														
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KEF	-	-	150.100,00	45,139980	27/10/22	-	-	79,880000	11.989.988,00	8,58	0,84
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	Z30KPF	-	-	370.000,00	60,825000	24/10/23	-	-	110,809900	40.999.330,00	29,33	2,86
ARA GRUP TOPLAMI						520.100,00						52.989.318,00	37,91	3,70
Y.Fonu Türk														
	ACTUS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		PYT	-	-	1.825.942,00	1,916818	22/12/21	-	-	9,056728	16.537.060,04	11,83	1,16
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		REB	-	-	4.400,00	1.000,000000	18/11/21	-	-	3,586,883028	15.782.285,32	11,29	1,10
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		RR5	-	-	2.414,00	1.408,467088	28/12/21	-	-	5,117,240433	12.353,018,41	8,84	0,86
	RE-PIE GAYRİMENKUL VE GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		RTF	-	-	708,00	5.943,954223	19/07/22	-	-	10,136,204750	7.176,432,96	5,13	0,50
	ZİRAAT BANKASI		ZPK	-	-	11.780.638,00	2,546550	28/07/23	-	-	2,966384	34.945.896,07	25,00	2,44
ARA GRUP TOPLAMI						13.614.102,00						86.794.692,80	62,09	6,06
GRUP TOPLAMI						14.134.202,00						139.784.010,80	100,00	9,89
KİRA SERTİFİKALARI														
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları														
	HAZINE	21/08/24	TRD210824T15	16,00	-	2.590.000,00	101,046900	06/05/22	22,610447	-	100,434109	2.601.243,41	6,50	0,18
	HAZINE	03/12/25	TRD031225T10	16,00	-	2.000.000,00	98,656300	08/11/21	23,631898	-	87,266547	1.745.330,95	4,36	0,12
	HAZINE	07/09/33	TRD070933T11	26,38	-	4.000.000,00	100,000000	19/12/23	26,007448	-	114,462611	4.578.504,44	11,44	0,32
ARA GRUP TOPLAMI						8.590.000,00						8.925.078,80	22,30	0,62
Özel Sektör Kira Sertifikaları														
	ZİRAAT KATILIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	15/02/24	TRDZKVK2428	10,23	-	10.000.000,00	100,000000	10/11/23	41,139263	-	105,746504	10.574.650,35	26,42	0,74
	Enlak Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	07/03/24	TRDEVKS32458	10,85	-	10.000.000,00	100,000000	29/11/23	46,187815	-	103,601320	10.360.132,02	25,89	0,72
	TOPRAK MAHSULLERİ OFİSİ A.Ş.	20/03/24	TRDHVKA32442	11,72	-	10.000.000,00	100,000000	20/12/23	55,961829	-	101,595536	10.159.553,56	25,39	0,71
ARA GRUP TOPLAMI						30.000.000,00						31.094.335,93	77,70	2,17
GRUP TOPLAMI						38.590.000,00						40.019.414,73	100,00	2,79

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF 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	1.431.756.116,21		101,29
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)			
B. HAZIR DEĞERLER	19.566,14		-
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	19.566,14	100,00	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C. ALACAKLAR	339.186,05		0,02
a) Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-
i) T1 Alacakları	-	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	339.186,05		
i) Diğer Alacaklar	85.000.000,38		1,20
ii) Vergi Alacakları	-		-
iii) Mevduat Alacakları	-		-
iv) Temettü	339.186,05		0,02
D. DİĞER VARLIKLAR			
E. BORÇLAR	(18.654.588,37)		(1,32)
a) Takasa Borçlar	(5.136.562,60)	27,54	(0,36)
i) Takasa Borçlar T1	-		-
ii) Takasa Borçlar T2	(5.136.562,60)		-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-		-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(3.624.644,18)		-
b) Yönetim Ücreti	(1.055.139,35)	5,66	(0,07)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Diğer Borçlar	(8.795.838,43)	47,38	(0,62)
i) Diğer Borçlar	(8.791.751,03)		(0,62)
ii) Denetim Reeskontu	(4.087,40)		-
f) Kayda Alma Ücreti	(42.403,81)	0,23	(0,00)
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	1.413.460.280,03		100,00

Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	85.617.377.086,950
Fon toplam değeri (TL)	1.413.460.280,03
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	14.382.622.913,050
Birim pay değeri (TL)	0,098276