

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

SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ														
Hisse Türk														
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYİ A.Ş.	-	AEFES	-	-	61.498	24,3198	28/12/23	-	-	137,50	8.455.975	0,38	0,35
	AG ANADOLU GRUBU HOLDİNG A.Ş.	-	AGHOL	-	-	40.000	127,3675	06/11/23	-	-	200,90	8.036.000	0,36	0,34
	AKBANK T.A.Ş.	-	AKBNK	-	-	222.439	13,4316	29/12/23	-	-	36,52	7.648.846	0,35	0,32
	AKBANK T.A.Ş.	-	Tem.Ver. AKBNK	-	-	3.268.272	13,4316	29/12/23	-	-	36,52	119.831.920	5,43	
	AKFEN YENİLENEBİLİR ENERJİ A.Ş.	-	AKFYE	-	-	866.500	17,7382	30/10/23	-	-	14,35	12.434.275	0,56	0,52
	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİ A.Ş.	-	AKSA	-	-	60.000	34,5139	01/03/23	-	-	103,00	6.180.000	0,28	0,26
	ARÇELİK A.Ş.	-	ARCLK	-	-	112.908	110,9025	21/12/23	-	-	128,50	14.508.678	0,66	0,61
	AŞELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ	-	ASELS	-	-	1.018.134	16,6265	21/12/23	-	-	44,98	45.795.667	2,08	1,92
	BÜYÜK SEFLER GIDA TURİZM TEKSTİL DANIŞMANLIK ORGANİZASYON EĞİTİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	BIGCH	-	-	90	34,5550	21/12/23	-	-	22,84	2.056	0,00	0,00
	BİOTREND ÇEVRE VE ENERJİ YATIRIMLARI A.Ş. BIOEN	-	BIOEN	-	-	220.308	8,0951	21/12/23	-	-	17,20	3.789.298	0,17	0,16
	Borlease Otomotiv Sanayi A.Ş.	-	BORLS	-	-	467.804	35,7874	28/12/23	-	-	33,00	15.437.532	0,70	0,65
	COCA COLA ICECEK A.Ş.	-	CCOLA	-	-	89.304	154,4892	23/05/23	-	-	525,50	46.929.252	2,13	1,97
	COCA COLA ICECEK A.Ş.	-	CCOLA	-	-	(64.922)	154,4892	29/12/23	-	-	525,50	(34.116.511)	(1,55)	(1,43)
	DOĞANLAR MOBİLYA GRUBU İMALAT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	DGNMO	-	-	3.598.857	8,1741	21/12/23	-	-	9,37	33.721.290	1,53	1,41
	DOĞUŞ OTOM.SERVİS VE TİC.A.Ş.	-	DOAS	-	-	205.351	244,1259	29/12/23	-	-	257,00	52.775.207	2,39	2,21
	DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU HOLD.A.Ş.	-	DOHOL	-	-	2.370.000	9,8221	24/10/23	-	-	11,06	26.212.200	1,19	1,10
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.	-	ENJSA	-	-	810	17,4617	20/10/23	-	-	45,54	36.887	0,00	0,00
	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.	-	ENKAI	-	-	77.622	20,4751	04/04/23	-	-	34,00	2.639.161	0,12	0,11
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	1.858.667	28,6886	21/12/23	-	-	41,00	76.205.347	3,46	3,19
	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	FROTO	-	-	73.488	292,0561	12/09/23	-	-	739,50	54.344.376	2,46	2,28
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	GARAN	-	-	819.095	30,3475	13/09/23	-	-	58,35	47.794.193	2,17	2,00
	TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.	-	ISCTR	-	-	4.249.183	7,1129	05/10/23	-	-	23,36	99.260.924	4,50	4,16
	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	-	KCHOL	-	-	744.500	44,4587	21/12/23	-	-	141,80	105.570.100	4,79	4,43
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	156.128	26,9797	29/12/23	-	-	20,98	3.275.565	0,15	0,14
	KERVAN GIDA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	KRVGD	-	-	(108.101)	26,9797	28/12/23	-	-	20,98	(2.267.959)	(0,10)	(0,10)
	LDR TURİZM A.Ş.	-	LIDER	-	-	380.641	12,0203	18/12/23	-	-	64,30	24.475.216	1,11	1,03

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
	LOKMAN HEKİM ENGÜRÜSAĞ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAHHÜT A.Ş.	-	LKMNH	-	-	615.162	60,4197	29/12/23	-	-	64,70	39.800.981	1,80	1,67
	LOKMAN HEKİM ENGÜRÜSAĞ SAĞLIK TURİZM EĞİTİM HİZMETLERİ VE İNŞAAT TAAHHÜT A.Ş.	-	LKMNH	-	-	150.000	60,6984	29/12/23	-	-	64,70	9.705.000	0,44	0,41
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	347.211	37,8291	14/12/23	-	-	116,50	40.450.082	1,83	1,70
	MİGROS TİC.A.Ş.	-	MGROS	-	-	233.293	136,7871	29/12/23	-	-	335,00	78.153.155	3,54	3,28
	MİGROS TİC.A.Ş.	-	MGROS	-	-	(15.001)	136,7871	28/12/23	-	-	335,00	(5.025.335)	(0,23)	(0,21)
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	-	MPARK	-	-	43	81,6851	14/11/23	-	-	149,00	6.407	0,00	0,00
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	-	56.536	427,8675	21/12/23	-	-	649,50	36.720.132	1,67	1,54
	SABANCI HOLDING A.Ş.	-	SAHOL	-	-	1.503.248	40,0347	14/12/23	-	-	60,45	90.871.342	4,12	3,81
	SABANCI HOLDING A.Ş.	-	SAHOL	-	-	(130.501)	40,0347	28/12/23	-	-	60,45	(7.888.785)	(0,36)	(0,33)
	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	-	SISE	-	-	1.501.197	24,3525	29/12/23	-	-	45,82	68.784.832	3,12	2,88
	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.	-	SOKM	-	-	858.573	33,6038	14/11/23	-	-	53,95	46.320.013	2,10	1,94
	SUN TEKSTİL SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	SUNTK	-	-	1.416.341	15,0399	29/12/23	-	-	19,60	27.760.274	1,26	1,16
	SUN TEKSTİL SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	SUNTK	-	-	585.000	19,3845	29/12/23	-	-	19,60	11.466.000	0,52	0,48
	SUWEN TEKSTİL SANAYİ PAZARLAMA A.Ş.	-	SUWEN	-	-	3.681.939	12,6850	14/12/23	-	-	25,68	94.552.194	4,29	3,96
	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.	-	TCELL	-	-	2.137.980	26,2923	09/10/23	-	-	56,10	119.940.678	5,44	5,03
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	832.247	69,8203	13/09/23	-	-	228,60	190.251.664	8,65	7,98
	TEKFEN HOLDING A.Ş.	-	TKFEN	-	-	500	31,8081	29/12/23	-	-	36,92	18.460	0,00	0,00
	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	TTKOM	-	-	670.350	9,3374	14/08/23	-	-	24,36	16.329.726	0,74	0,68
	TURK TRAKTOR VE ZIRAAT MAKİNELERİ A.S.	-	TTRAK	-	-	11.529	128,8498	08/11/23	-	-	712,00	8.208.919	0,37	0,34
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	1.251.034	37,4765	29/12/23	-	-	143,00	178.897.862	8,11	7,50
	VESTEL BEYAZ EŞYA SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESBE	-	-	292.294	5,9935	21/12/23	-	-	16,00	4.676.702	0,21	0,20
	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESTL	-	-	976.290	45,7308	06/10/23	-	-	46,24	45.143.650	2,05	1,89
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.	-	YATAS	-	-	839.718	31,0739	21/12/23	-	-	24,24	20.354.764	0,92	0,85
	YATAŞ YATAK VE YORGAN SANAYİ TİCARET A.Ş.	-	YATAS	-	-	(63.639)	31,0739	28/12/23	-	-	24,24	(1.542.609)	(0,07)	(0,06)
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	-	YKBNK	-	-	3.554.743	5,9031	18/09/23	-	-	19,54	69.459.678	3,15	2,91
	ZİRAAT GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	-	ZRGYO	-	-	2.532.863	4,9226	28/12/23	-	-	5,67	14.361.333	0,65	0,60
	AKÇANSA ÇİMENTO SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	AKCNS	-	-	25.000	61,9050	30/03/23	-	-	142,30	3.557.500	0,16	0,15
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.	-	BIMAS	-	-	504.091	104,7879	29/12/23	-	-	300,75	151.605.368	6,88	6,36

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
	İNDEKS BİLGİSAYAR SİSTEMLERİ MÜHENDİSLİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	İNDES	-	-	3.302.341	5,6471	21/12/23	-	-	5,96	19.681.955	0,89	0,83
	İNDEKS BİLGİSAYAR SİSTEMLERİ MÜHENDİSLİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	İNDES	-	-	(3.302.101)	5,6472	28/12/23	-	-	5,96	(19.680.522)	(0,89)	(0,83)
	LOGO YAZILIM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	LOGO	-	-	99.002	59,9916	17/07/23	-	-	73,95	7.321.198	0,33	0,31
	Mega Metal Sanayi ve Ticaret A.Ş.	-	MEGMT	-	-	500	28,3000	12/12/23	-	-	22,32	11.160	0,00	0,00
	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.	-	TAVHL	-	-	209.865	48,3332	17/07/23	-	-	107,50	22.560.488	1,02	0,95
	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.	-	TOASO	-	-	215.837	153,1342	29/12/23	-	-	210,00	45.325.770	2,06	1,90
	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.	-	TOASO	-	-	(9.631)	153,1342	28/12/23	-	-	210,00	(2.022.510)	(0,09)	(0,08)
GRUP TOPLAMI						45.672.431						2.205.113.021	100,00	87,43
REPO														
	MGROS	02/01/24	-	47,50	-	25.632.740	47,5000	29/12/23	76.924	25.632.740	43,57	(25.632.740)	17,53	(1,07)
	AKBNK	02/01/24	-	47,50	-	20.104.110	47,5000	29/12/23	544.960	20.104.110	43,57	(20.104.110)	13,75	(0,84)
	AKBNK	02/01/24	-	47,50	-	100.520.548	47,5000	29/12/23	2.723.312	100.520.548	43,57	(100.520.548)	68,72	(4,21)
GRUP TOPLAMI						146.257.397						(146.257.397)	100,00	(6,12)
DİĞER														
Borsa Y.Fonu Yabancı														
	ALBARAKA GAYRİMENKUL PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ALDUK	-	-	17.614	4.270.0000	21/12/23	-	-	6.000,00	105.684.000	37,98	4,43
	LETVEN CAPITAL GİRİŞİM SERMAYESİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	LDG	-	-	88.901.932	1,1741	27/12/23	-	-	1,59	141.515.607	50,85	5,93
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZCD	-	-	222.375	1,1242	09/01/23	-	-	1,61	358.163	0,13	0,02
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	ZJL	-	-	400.200	0,9994	13/08/21	-	-	5,93	2.374.316	0,85	0,10
GRUP TOPLAMI						89.542.121						249.932.086	89,81	10,48

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
VIOP Nakit Teminatı														
		-	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	3.138.803	-	-	-	-	3.138.803	100,00	0,13
GRUP TOPLAMI						3.138.803						3.138.803	100,00	0,13
DİĞER														
Döviz														
	ABD HAZİNE	-	USD	-	-	83.688	21,3141	29/12/23	-	-	29,44	2.463.612	0,00	0,10
GRUP TOPLAMI						83.688						2.463.612	0,00	0,10
FON PORTFÖY DEĞERİ												2.340.288.746		100,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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	2.340.288.746	-	98,11
B. HAZIR DEĞERLER	3.163.746	-	0,13
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	700.135	22,13	0,03
c) Diğer Hazır Değerler	2.463.611,72	77,87	0,10
C. ALACAKLAR	72.348.137	-	3,03
a) Takastan Alacaklar Toplamı	72.114.197	100,00	3,02
i) T1 Alacakları	49.564.254,01	-	-
ii) T2 Alacakları	22.549.943	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	233.940	-	0,01
i) Diğer Alacaklar	-	-	-
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	233.940	-	0,01
D. BORÇLAR	(30.436.049)	-	(1,28)
a) Takasa Borçlar	(20.444.714)	67,17	(0,86)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	(20.444.714)	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(5.696.763,10)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(4.193.278)	13,78	(0,18)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	0,00	-
e) DİĞER BORÇLAR	(29.733)	0,33	-
i) Diğer Borçlar	(18.033,05)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(11.700,10)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(71.560,94)	0,24	(0,00)
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	2.385.364.581		100,00

Toplam katılma payı/Pay sayısı	500.000.000.000,000
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	485.438.612.737,437
Fon toplam değeri (TL)	2.385.364.580,61
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	14.561.387.262,563
Birim pay değeri (TL)	0,163814