

**AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
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**



AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

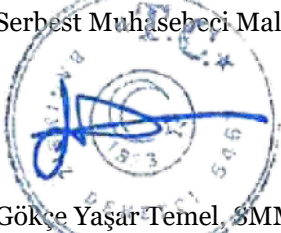
**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Agesa Hayat ve Emeklilik A.Ş. Orta Vadeli Borçlanma Araçları 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 belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2023 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Agesa Hayat ve Emeklilik A.Ş. Orta Vadeli Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun 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 Agesa 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.



Gökçe Yaşar Temel, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 1 Nisan 2024

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM
FONU

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

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI 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	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
	SAHOL	-	SAHOL	-	-	1	9,4600	09/10/19	-	-	-	60,45	-	60	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1								60	100,00	0,00
BORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvili																
	HAZİNE	20/03/24	TRT200324T13	102,08	-	485.000	95,9105	15/03/23	41,0909	-	-	97,65	-	473.587	0,47	0,39
	HAZİNE	17/04/24	TRT170424T17	0,00	-	2.150.000	107,1489	09/06/23	33,3705	-	-	101,51	-	2.182.443	2,15	1,79
	HAZİNE	24/07/24	TRT240724T15	0,00	-	985.000	98,1337	06/12/23	42,2498	-	-	90,14	-	887.837	0,87	0,73
	HAZİNE	04/12/24	TRT041224T12	97,00	-	2.000.000	101,0879	16/05/23	37,8322	-	-	81,80	-	1.636.069	1,61	1,34
	HAZİNE	01/10/25	TRT011025T16	74,88	-	17.500.000	90,4878	15/12/23	39,3301	-	-	74,33	-	13.008.339	12,79	10,67
	HAZİNE	11/02/26	TRT110226T13	97,00	-	1.245.000	98,4634	11/09/23	33,7545	-	-	73,61	-	916.404	0,90	0,75
	HAZİNE	02/09/26	TRT020926T17	107,60	-	13.330.000	121,6237	25/08/23	32,0015	-	-	82,73	-	11.028.119	10,85	9,04
	HAZİNE	24/02/27	TRT240227T17	64,30	-	2.500.000	197,9648	04/12/23	29,5354	-	-	70,18	-	1.754.528	1,73	1,44
	HAZİNE	09/06/27	TRT090627T12	121,50	-	14.500.000	126,7891	05/12/23	29,0654	-	-	86,07	-	12.479.904	12,27	10,23
	HAZİNE	11/08/27	TRT110827T16	70,30	-	13.200.000	65,5721	06/12/23	25,9859	-	-	71,68	-	9.461.755	9,30	7,76
	HAZİNE	15/09/27	TRT150927T11	0,00	-	18.500.000	66,1635	21/12/23	30,1291	-	-	63,33	-	11.715.667	11,52	9,61
	HAZİNE	19/07/28	TRT190728T34	0,00	-	2.000.000	148,6270	26/07/23	(0,428859)	-	-	137,15	-	2.743.048	2,70	2,25
	HAZİNE	19/07/28	TRT190728T18	0,00	-	23.000.000	87,9690	06/12/23	26,0647	-	-	88,38	-	20.327.883	19,99	16,67
	HAZİNE	08/11/28	TRT081128T15	108,60	-	6.000.000	109,8718	15/12/23	28,9286	-	-	114,50	-	6.869.752	6,76	5,63
	HAZİNE	13/11/30	TRT131130T14	116,40	-	160.000	78,4863	04/01/23	23,1179	-	-	65,90	-	105.442	0,10	0,09
	HAZİNE	28/04/32	TRT280432T14	0,00	-	130.000	188,5288	03/03/23	24,5153	-	-	97,24	-	126.408	0,12	0,10
ARA GRUP TOPLAMI						117.685.000								95.717.186	94,13	78,49

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI 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	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
Eurobond Türk																
	HAZİNE	22/03/24	US900123CF53	0,00	-	110.000	100,5007	09/11/23	4,8421	-	-	101,75	-	3.294.747	3,24	2,70
ARA GRUP TOPLAMI						110.000								3.294.747	3,24	2,70
Özel Sektör																
Özel Sektör Tahvil																
	AEFES	18/01/24	TRSEFES12413	35,44	-	2.000.000	100,0000	22/12/22	32,6404	-	-	133,67	-	2.673.418	2,63	2,19
ARA GRUP TOPLAMI						2.000.000								2.673.418	2,63	2,19
GRUP TOPLAMI						119.795.000								101.685.351	100,00	83,38
MEVDUAT																
	AKBANK T.A.S.	02/01/24	-	11,00	-	2.150.000	-	29/12/23	-	-	2.152.592	11,00	-	2.151.944	100,00	1,76
GRUP TOPLAMI						2.150.000								2.151.944	100,00	1,76
DİĞER																
Y.Fonu Türk																
	AKPORTFOY	-	TAV-AK PORTFÖY AVIVASA EMEK. TEKNOLOJİ GSYF	-	-	1.046.175	1,7206	02/05/23	-	-	-	4,08	-	4.270.203	47,86	3,50
ARA GRUP TOPLAMI						1.046.175								4.270.203	47,86	3,50
Y.Fonu Yabancı																
	AKPORTFOY	-	PAL-USD-AK PORTFÖY ALTINCI SERBEST DÖVİZ FON	-	-	147.171	1,0289	21/08/23	-	-	-	1,0738	-	4.652.115	52,14	3,81
ARA GRUP TOPLAMI						147.171								4.652.115	52,14	3,81

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI 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 Tammı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oran	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
GRUP TOPLAMI						1.193.346								8.922.318	100,00	7,31
VIOP Nakit Teminatı																
		-	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	1.482.368	-	-	-	-	-	-	1.482.368	100,00	1,30
GRUP TOPLAMI						1.482.368								1.482.368	100,00	1,30
DİĞER																
Döviz																
	FED	-	USD	-	-	262.620	29,0728	29/12/23	-	-	-	29,44	-	7.731.058	0,00	6,34
GRUP TOPLAMI						262.620								7.731.058	0,00	6,34
FON PORTFÖY DEĞERİ														114.242.041		100,00

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI 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	114.242.041	-	93,68
B. HAZIR DEĞERLER	7.739.234	-	6,35
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	8.176	0,11	0,01
c) Diğer Hazır Değerler	7.731.058,02	99,89	6,34
C. ALACAKLAR	181.772	-	0,15
a) Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-
i) T1 Alacakları	-	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	181.772	-	0,15
i) Diğer Alacaklar	181.772	-	0,15
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	-	-	-
D. BORÇLAR	(209.061)	-	(0,17)
a) Takasa Borçlar	-	-	0,00
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	-	-	-
b) Yönetim Ücreti	(192.495)	92,08	(0,16)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	0,00	-
e) DİĞER_BORÇLAR	(12.904)	7,92	(0,01)
i) Diğer Borçlar	(4.994,66)	-	-
ii) Denetim Reeskontu	(7.909,80)	-	(0,01)
f) Kayda Alma Ücreti	(3.660,63)	1,75	(0,00)
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	121.953.986		100,00