

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ 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



**AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ 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**

Agesa Hayat ve Emeklilik A.Ş. İkinci 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 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. İkinci Değişken 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.
İKİNCİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-4
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	5

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş

İKİNCİ DEĞİŞKEN 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 Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
BORÇLANMA SENETLERİ															
Eurobond Türk	HAZİNE	13/03/25	US900123CX69	5,26	-	300.000	95,859700	27/12/22	5,691600	-	99,68	-	8.802.917	2,84	1,89
	HAZİNE	25/03/27	US900123CL22	9,10	-	200.000	98,249000	26/09/22	6,379738	-	100,74	-	5.931.368	1,91	1,27
	HAZİNE	17/01/28	US900123DF45	0,00	-	200.000	103,874300	25/11/22	6,717044	-	115,89	-	6.823.445	2,20	1,47
	HAZİNE	17/02/28	US900123CP36	7,97	-	365.000	85,127500	01/03/22	6,422084	-	97,58	-	10.484.475	3,38	2,25
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	16/10/28	XS2445343689	11,07	-	500.000	99,531000	13/09/23	9,339742	-	109,11	-	16.060.555	5,17	3,45
	HAZİNE	24/10/28	US900123CQ19	5,70	-	410.000	101,715000	20/09/21	6,515920	-	99,92	-	12.059.572	3,89	2,59
	HAZİNE	14/03/29	US900123DH01	8,72	-	400.000	102,912500	29/03/23	6,940602	-	113,74	-	13.393.262	4,32	2,88
	HAZİNE	26/04/29	US900123CT57	8,75	-	400.000	96,150300	25/03/20	6,840141	-	105,28	-	12.397.356	3,99	2,66
	HAZİNE	26/06/31	US900123DC14	8,80	-	150.000	88,343700	03/01/23	7,075589	-	93,83	-	4.143.098	1,33	0,89
	HAZİNE	20/09/33	US900123DD96	8,90	-	200.000	83,433300	14/04/22	7,191863	-	97,83	-	5.760.096	1,86	1,24
	HAZİNE	14/02/34	US900123AT75	5,71	-	90.000	125,102800	22/07/22	7,225357	-	109,41	-	2.898.835	0,93	0,62
	HAZİNE	17/03/36	US900123AY60	0,00	-	33.000	99,977600	26/02/21	7,482708	-	98,12	-	953.223	0,31	0,20
	HAZİNE	05/03/38	US900123BB58	7,39	-	32.000	98,391500	23/02/22	7,562441	-	100,76	-	949.227	0,31	0,20
	HAZİNE	14/01/41	US900123BJ84	6,78	-	535.000	87,213500	29/12/23	7,552506	-	88,22	-	13.893.917	4,48	2,98
	HAZİNE	13/05/47	US900123CM05	10,22	-	200.000	62,224200	29/09/22	7,850137	-	79,73	-	4.694.457	1,51	1,01
ARA GRUP TOPLAMI						4.015.000							119.245.803	38,43	25,60
Eurobond Yabancı	HAZİNE	16/12/24	US91282CDN83	4,85	-	1.000.000	96,454100	28/12/23	4,838210	-	96,50	-	28.407.922	9,16	6,10
	HAZİNE	31/10/25	US91282CAT80	4,36	-	1.000.000	92,844500	28/12/23	4,354780	-	92,93	-	27.356.802	8,81	5,88
	HAZİNE	17/11/25	US912828M565	4,33	-	500.000	96,529100	27/12/23	4,328153	-	96,60	-	14.219.210	4,58	3,05
	HAZİNE	01/12/25	US91282CAZ41	4,32	-	1.000.000	92,813800	28/12/23	4,316641	-	92,90	-	27.347.146	8,81	5,87
	HAZİNE	31/12/25	US91282CBC47	4,25	-	500.000	92,781100	27/12/23	4,267165	-	92,85	-	13.666.699	4,40	2,94
	HAZİNE	02/02/26	US91282CBH34	4,25	-	500.000	92,452600	27/12/23	4,249299	-	92,53	-	13.620.069	4,39	2,93
	HAZİNE	31/07/26	US91282CCP41	4,10	-	500.000	91,776500	27/12/23	4,112341	-	91,87	-	13.522.349	4,36	2,90
	HAZİNE	31/08/26	US91282CCW91	4,10	-	500.000	91,850400	26/12/23	4,090355	-	91,96	-	13.535.935	4,36	2,91
ARA GRUP TOPLAMI						5.500.000							151.676.131	48,87	32,58

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş

İKİNCİ DEĞİŞKEN 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 Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
Özel Sektör															
Finansman Bonosu	İŞ LEASING	30/01/24	TRFISFN12412	88,56	-	3.000.000	88,563400	14/08/23	29,996880	-	97,94	-	2.938.117	0,95	0,63
	ISFAK	27/02/24	TRFISFA22418	44,50	-	8.000.000	93,184000	29/12/23	53,640883	-	93,51	-	7.481.079	2,41	1,61
	TATGD	15/04/24	TRFTATK42437	22,07	-	100.000	100,000000	30/11/23	50,182053	-	108,59	-	108.593	0,03	0,02
	Koç Sistem Bilgi	16/04/24	TRFKCSS42411	22,07	-	3.000.000	100,000000	20/10/23	50,173721	-	108,47	-	3.254.169	1,05	0,70
	BNP PARIBAS	25/07/24	TRFBNPF72425	99,90	-	1.590.000	100,368600	23/11/23	39,018617	-	115,33	-	1.833.708	0,59	0,39
ARA GRUP TOPLAMI						15.690.000							15.615.665	5,03	3,35
Özel Sektör Tahvil															
	KOÇ FINANSMAN A.Ş	11/01/24	TRSKCTF12420	0,00	-	700.000	113,945500	18/10/23	32,114716	-	134,14	-	938.998	0,30	0,20
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş	28/02/24	TRSENSA22414	99,57	-	3.000.000	114,972100	19/07/23	31,389196	-	129,60	-	3.888.105	1,25	0,84
	ARCLK	05/04/24	TRSARCL42412	100,10	-	1.850.000	102,857000	19/09/23	22,403179	-	108,59	-	2.008.840	0,65	0,43
	ENERJİSA ENERJİ A.Ş	18/10/24	TRSENSAE2429	8,00	-	3.000.000	100,000000	21/10/22	67,496696	-	111,18	-	3.335.330	1,07	0,72
	ENERJİSA ELEKTRİK	17/01/25	TRSENSA12514	99,50	-	4.000.000	107,915000	28/12/23	54,405433	-	108,43	-	4.337.186	1,40	0,93
	SİSE	04/11/25	TRSSISEK2519	49,69	-	7.880.000	100,000000	30/10/23	56,326914	-	108,98	-	8.587.820	2,77	1,84
ARA GRUP TOPLAMI						20.430.000							23.096.279	7,44	4,96
GRUP TOPLAMI						36.120.000							38.711.944	12,47	8,31
TERS REPO															
	HAZİNE	2/1/2024	TRT190728T34	42,21	-	8.037.006	42,210000	29/12/23	-	-	43,57	-	8.027.441	100,00	1,72
GRUP TOPLAMI						8.037.006							8.027.441	100,00	1,72
MEVDUAT															
	AKBANK T.A.S.	02/01/24	-	11,00	-	1.038.000	-	29/12/23	-	-	11,00	-	1.038.938	2,17	0,22
	TC ZIRAAT BANKASI	25/01/24	-	46,50	-	10.000.000	-	20/12/23	-	-	46,50	-	10.149.753	21,20	2,18
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	25/01/24	-	45,00	-	10.000.000	-	21/12/23	-	-	45,00	-	10.132.839	21,16	2,18
	HALK BANKASI	31/01/24	-	43,50	-	15.016.849	-	29/12/23	-	-	43,50	-	15.068.140	31,48	3,24
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	16/02/24	-	45,00	-	10.876.196	-	15/11/23	-	-	45,00	-	11.487.870	23,99	2,47

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş

İKİNCİ DEĞİŞKEN 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 Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
GRUP TOPLAMI						46.931.045							47.877.540	100,00	10,29
TPP															
	-	11/01/24	-	42,75	-	10.163.973	42,750000	28/12/23	-	-	43,07	-	10.045.643	100,00	2,16
GRUP TOPLAMI						10.163.973							10.045.643	100,00	2,16
KATILIM HESABI															
	VAKIF KATILIM	19/01/24	-	40,00	-	5.000.000	-	18/10/23	-	-	40,00	-	5.410.959	100,00	1,16
GRUP TOPLAMI						5.000.000							5.410.959	100,00	1,16
DİĞER															
Y. Fonu Türk															
	AKPORTFOY	-	-	-	-	193.458.816	0,043937	24/10/23	-	-	0,05	-	9.106.106	35,83	1,96
	AKPORTFOY	-	-	-	-	254.820.836	0,046522	24/10/23	-	-	0,06	-	14.820.380	58,32	3,18
ARA GRUP TOPLAMI						448.279.652							23.926.486	94,15	5,14
Y.Fonu Yabancı															
	AKPORTFOY	-	-	-	-	50.004	0,999909	19/07/23	-	-	1,01	-	1.487.163	5,85	0,32
ARA GRUP TOPLAMI						50.004							1.487.163	5,85	0,32
GRUP TOPLAMI						448.329.656							25.413.649	100,00	5,46
TÜREV															
Futures															
Uzun															
	-	-	F_USDTRY0224	-	-	400	31,355100	26/12/23	-	-	31,38	-	12.550.000	0,00	0,00

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş

İKİNCİ DEĞİŞKEN 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 Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
GRUP TOPLAMI						400							12.550.000	0,00	0,00
VIOP NAKİT TEMİNATI															
	-	-	-	-	-	4.114.376	-	-	-	-	-	-	4.114.376	100,00	1,00
GRUP TOPLAMI						4.114.376							4.114.376	100,00	1,00
DİĞER															
Döviz															
	EU	-	EUR	-	-	1.023	18,374760	29/12/23	-	-	32,57	-	33.331	0,00	0,01
	FED	-	USD	-	-	1.857.403	29,311523	29/12/23	-	-	29,44	-	54.678.615	0,00	11,75
GRUP TOPLAMI						1.858.427							54.711.946	0,00	11,76
KİRA SERTİFİKALARI															
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
	AKLEASE	28/08/24	TRDEMVK82423	0,00	-	700.000	106,429700	09/11/23	43,072899	-	102,97	-	720.816	0,23	0,15
GRUP TOPLAMI						700.000							720.816	0,23	0,15
FON PORTFÖY DEĞERİ						568.911.056							411.244.301		100,00

AGESA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ 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	411.244.301	-	88,34
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	-	-	-
B. HAZIR DEĞERLER	54.712.316	-	11,75
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	369	-	-
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	54.711.946,96	100,00	11,75
C. ALACAKLAR	330.465	-	0,07
a) Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-
i) T1 Alacakları	-	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	330.465	-	0,07
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E. BORÇLAR	(754.733)	-	(0,16)
a) Takasa Borçlar	-	-	-
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	-	-	-
b) Yönetim Ücreti	(727.005)	96,33	(0,16)
c) İhtiyatlar	-	-	-
d) Kayda Alma Ücreti	(13.969)	1,85	-
e) Diğer Borçlar	(13.759)	3,67	-
i) Denetim Ücreti	-	-	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Denetim Reeskontu	(8.557)	-	-
vi) Diğer	(5.202)	-	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon Toplam Değeri	465.532.349		100,00