

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

1 OCAK - 31 ARALIK 2024 HESAP DÖNEMİNE AİT
FİYAT RAPORU

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

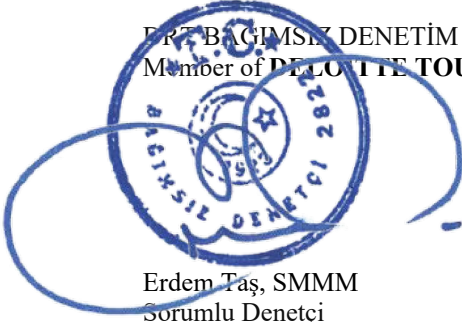
Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2024 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) ("Tebliğ") hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını SPK'nın konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2024 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2024 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları Tebliğ hükümlerine ve SPK tarafından belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen SPK, Kurucu Fon Kurulu ve Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş.'nin ("Kurucu") bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
Member of DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED



Erdem Taş, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 27 Mart 2025

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

BAĞIMSIZ DENETİMDEN GEÇMİŞ 1 OCAK - 31 ARALIK 2024 HESAP DÖNEMİNE AİT FİYAT TABLOSU
(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

08/01/2025 10:17

TÜRKİYE HAYAT ve EMEKLİLİK A.Ş.
VEL-PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU 31 Aralık 2024 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR
FON TOPLAM DEĞER TABLOSU

	<u>TUTAR (TL)</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM</u>	<u>FON TOPLAM DEĞERİ</u>	<u>10.595.112.881,29</u>
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	10.603.584.999,97		100,08	Toplam Pay Sayısı	100.000.000.000,000
B. HAZİR DEĞERLER	224.116,40		0,00	Dolaşımdaki Pay	52.870.054.672,417
a) Kasa	0,00	0,00	0,00	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	47.129.945.327,583
b) Bankalar	224.116,40	100,00	0,00		
c) Diğer Hazır Değerler	0,00	0,00	0,00		
C. ALACAKLAR	388,92		0,00	Dolaşımdaki Pay Oranı	% 52,87
a) Takastan Alacaklar Toplamı	0,00	0,00	0,00	BİRİM PAY DEĞERİ	0,200399
i) T1 Alacakları	0,00		0,00	Günlük Vergi	
ii) T2 Alacakları	0,00		0,00	Günlük Yönetim Ücreti	529.771,54
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	0,00		0,00	Bir Gün Önceki Fiyat	0,199905
b) Diğer Alacaklar	388,92		0,00	Bir Gün Önceki Vergi	0,00
i) Diğer Alacaklar	388,92		0,00	Getiri (%)	0,247117
ii) Vergi Alacakları	0,00		0,00	Duration	419,37
iii) Mevduat Alacakları	0,00		0,00		
iv) Temettu	0,00		0,00		
D. BORÇLAR	-8.696.624,00		-0,08	USD TCMB ALIS KURU	35,2803
a) Takasa Borçlar	-1.019.719,78	11,73	-0,01	EUR TCMB ALIS KURU	36,7362
i) T1 Borçları	0,00				
ii) T2 Borçları	0,00				
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-1.019.719,78				
iv) İhbarlı FonPay Takas	0,00				
b) Yönetim Ücreti	-7.290.906,93	83,84	-0,07		
c) Ödenecek Vergi	0,00	0,00	0,00		
d) İhtiyatlar	0,00	0,00	0,00		
e) DİĞER BORÇLAR	-68.143,89	4,44	0,00		
i) Diğer Borçlar	-3.971,71		0,00		
ii) Denetim Reeskontu	-64.172,18		0,00		
f) Kayda Alma Ücreti	-317.853,40	3,65	0,00		
g) Krediler	0,00	0,00	0,00		

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

BAĞIMSIZ DENETİMDEN GEÇMİŞ 1 OCAK - 31 ARALIK 2024 HESAP DÖNEMİNE AİT FİYAT TABLOSU
(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

VEL-PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

08/01/2025 10:17

VEL-PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU 31 Aralık 2024 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR																				
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)	
BORÇLANMA SENETLERİ																				
Devlet Tahvili																				
TRT140126T37	TL	HAZINE	14/01/26	377	TRT140126T37	0,00	4	25.000.000,00	109,059200	12/06/24	61,907563		787092846216841394		112,568714	28.142.178,48	0,87	0,27	0,27	
TRT200526T19	TL	HAZINE	20/05/26	503	TRT200526T19	0,00	4	78.000.000,00	102,418400	27/08/24	62,222199		790100560274623268		107,157077	83.582.519,95	2,58	0,79	0,79	
TRT190826T19	TL	HAZINE	19/08/26	594	TRT190826T19	0,00	4	530.090.000,00	100,824100	25/11/24	62,112819		793584087989326174		107,407318	569.355.451,62	17,58	5,21	5,37	
TRT160627T13	TL	HAZINE	16/06/27	895	TRT160627T13	0,00	4	369.500.000,00	100,224300	20/11/24	62,020157		793465340733489423		103,157216	381.165.914,04	11,78	3,59	3,60	
TRT131027T10	TL	HAZINE	13/10/27	1014	TRT131027T10	0,00	4	330.833.559,00	106,600600	31/12/24	65,016250		795087945018210616		110,858100	366.755.798,76	11,33	3,46	3,46	
TRT171127T15	TL	HAZINE	17/11/27	1049	TRT171127T15	0,00	2	75.500.000,00	97,502300	17/01/24	48,028207		781274230682644669		98,562605	74.414.766,85	2,30	0,70	0,70	
TRT190128T14	TL	HAZINE	19/01/28	1112	TRT190128T14	0,00	4	95.000.000,00	107,285800	05/12/24	65,832835		794059077012507155		108,976668	103.527.834,16	3,20	0,98	0,98	
TRT010328T12	TL	HAZINE	01/03/28	1154	TRT010328T12	0,00	4	155.500.000,00	103,009400	22/08/24	64,700746		789942505478118451		102,964564	160.109.897,36	4,95	1,51	1,51	
TRT170528T12	TL	HAZINE	17/05/28	1231	TRT170528T12	0,00	4	385.500.000,00	104,099200	24/12/24	65,398500		794810868087999821		104,661632	403.470.590,47	12,47	3,80	3,81	
TRT060928T11	TL	HAZINE	06/09/28	1343	TRT060928T11	0,00	4	173.846.257,00	103,886800	27/12/24	61,035040		794929615343814522		101,880550	177.115.522,32	5,47	1,67	1,67	
TRT130928T12	TL	HAZINE	13/09/28	1350	TRT130928T12	0,00	2	83.000.000,00	95,542500	31/05/23	50,994623		772131224564144776		100,073705	83.061.175,29	2,57	0,78	0,78	
TRT061228T16	TL	HAZINE	06/12/28	1434	TRT061228T16	0,00	4	179.000.000,00	98,173400	30/12/24	60,934601		794969472640323608		101,980336	182.544.801,80	5,64	1,72	1,72	
TRT031029T10	TL	HAZINE	03/10/29	1735	TRT031029T10	0,00	2	1.000.000,00	89,825000	04/01/24	50,603772		780759659240846820		96,262747	962.627,47	0,03	0,01	0,01	
TRT050630T11	TL	HAZINE	05/06/30	1980	TRT050630T11	0,00	2	40.000.000,00	90,179100	03/01/24	50,635076		780719527066413401		90,631229	36.252.491,44	1,12	0,34	0,34	
GRUP TOPLAMI						2.521.769.816,00						2.650.461.570,01						81,89	24,83	25,01
Özel Sektör																				
Finansman Bonosu																				
TRFTRFN42517	TL	TURK FİNANSMAN AŞ	09/04/25	97	TRFTRFN42517	25,41	1	1.200.000,00	100,000000	16/10/24	60,361367				110,618950	1.327.427,40	0,04	0,01	0,01	
TRFTRYK42514	TL	TIRYAKI AGRO GIDA	10/04/25	98	TRFTRYK42514	24,54	1	18.500.000,00	100,000000	23/10/24	60,635874				109,658072	20.286.743,41	0,63	0,19	0,19	
TRFVEST42511	TL	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYI VE TİCARET A.Ş.	25/04/25	113	TRFVEST42511	24,45	1	10.000.000,00	100,000000	01/11/24	57,814717				108,058251	10.805.825,11	0,33	0,10	0,10	
TRFYEOT52513	TL	YEO TEKNOLOJİ ENERJİ VE ENDÜSTRİ A.Ş.	22/05/25	140	TRFYEOT52513	2,25	2	2.800.000,00	100,000000	23/05/24	73,853388				105,644753	2.958.053,08	0,09	0,03	0,03	
TRFAKIE2519	TL	AKFEN İNŞAAT TURİZM VE TİCARET A.Ş.	24/10/25	295	TRFAKIE2519	4,25	4	16.000.000,00	100,000000	25/10/24	-7,100655				110,804861	17.728.777,84	0,55	0,17	0,17	
GRUP TOPLAMI						48.500.000,00						53.106.826,84						1,64	0,50	0,50

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

BAĞIMSIZ DENETİMDEN GEÇMİŞ 1 OCAK - 31 ARALIK 2024 HESAP DÖNEMİNE AİT FİYAT TABLOSU
(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

VEL-PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

08/01/2025 10:17

VEL-PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU 31 Aralık 2024 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR																			
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
Özel Sektör Tahvil																			
TRSZORN22529	TL	ZORLU ENERJİ ELEKTRİK ÜRETİMİ A.Ş.	19/02/25	48	TRSZORN22529	49,40	4	8.000.000,00	100,000000	01/02/24	61,497605				109,532311	8.762.584,90	0,27	0,08	0,08
TRSZORN52518	TL	ZORLU ENERJİ ELEKTRİK ÜRETİMİ A.Ş.	08/05/25	126	TRSZORN52518	64,82	5	15.200.000,00	100,000000	07/03/24	68,938473				106,256919	16.151.051,69	0,50	0,15	0,15
TRFTAMF62513	TL	TAM FİNANS FAKTORİNG A.Ş.	02/06/25	151	TRFTAMF62513	3,36	3	8.000.000,00	100,000000	12/06/24	73,636228				103,740332	8.299.226,52	0,26	0,08	0,08
TRFISGY62511	TL	İŞ GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	12/06/25	161	TRFISGY62511	4,48	4	5.000.000,00	100,000000	13/06/24	67,453584				101,992404	5.099.620,18	0,16	0,05	0,05
TRSZORN82515	TL	ZORLU ENERJİ ELEKTRİK ÜRETİMİ A.Ş.	06/08/25	216	TRSZORN82515	4,48	4	10.000.000,00	100,000000	11/07/24	59,978800				111,497919	11.149.791,94	0,34	0,10	0,11
TRSSISE32613	TL	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	03/03/26	425	TRSSISE32613	9,80	4	48.330.000,00	100,000000	26/02/24	66,499301				105,633378	51.052.611,35	1,58	0,48	0,48
TRSYKFK62618	TL	YAPI KREDİ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	08/06/26	522	TRSYKFK62618	4,48	4	6.600.000,00	100,000000	10/06/24	68,871538				102,098577	6.738.506,07	0,21	0,06	0,06
TRSTPRS72614	TL	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	20/07/26	564	TRSTPRS72614	3,70	4	50.000.000,00	100,000000	23/07/24	65,747690				110,092253	55.046.126,34	1,70	0,52	0,52
TRSENSAE2619	TL	ENERJISA ENERJİ A.Ş.	19/10/26	655	TRSENSAE2619	3,70	4	12.500.000,00	100,000000	21/10/24	-0,755997				110,398702	13.799.837,81	0,43	0,13	0,13
TRSTHALK3419	TL	TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş.	29/11/34	3618	TRSTHALK3419	1,19	4	240.000.000,00	100,000000	11/12/24	4,128120				103,038908	247.293.378,48	7,64	2,33	2,33
GRUP TOPLAMI						403.630.000,00									423.392.735,28		13,09	3,98	3,99
GRUP TOPLAMI						452.130.000,00									476.499.562,12		14,73	4,48	4,49

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

BAĞIMSIZ DENETİMDEN GEÇMİŞ 1 OCAK - 31 ARALIK 2024 HESAP DÖNEMİNE AİT FİYAT TABLOSU
(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

VEL-PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

08/01/2025 10:17

VEL-PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU 31 Aralık 2024 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR																			
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
İleri Valörlü Alışlar Türk																			
Devlet Tahvili																			
TRT061228T16	TL	HAZINE	06/12/28	1434	TRT061228T16	0,00	4	1.000.000,00	101,971978	02/01/25			795127527436813209		101,962000	1.019.620,00	0,03	0,01	0,01
GRUP TOPLAMI								1.000.000,00								1.019.620,00	0,03	0,01	0,01
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet																			
TRPFBA112529	TL	ARENA BİLGİSAYAR SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	02/01/25	0	TRPFBA112529	51,50		3.750.000,00	90,086000	16/10/24	0,000000				100,000000	3.750.000,00	0,12	0,04	0,04
TRPTMKS12527	TL	Türkiye Menkul Kıymetleştirme Şirketi Fibabanka (2) No'lu Varlık Finansmanı Fonu	03/01/25	1	TRPTMKS12527	51,00		13.000.000,00	94,208100	20/11/24	64,040010				99,864492	12.982.383,94	0,40	0,12	0,12
TRPTMKT12525	TL	TMKŞ Tarfın Birinci Varlık Finansmanı	03/01/25	1	TRPTMKT12525	15,68	1	10.000.000,00	100,000000	19/09/24	65,139580				115,523317	11.552.331,67	0,36	0,11	0,11
TRPTM5F12539	TL	Türkiye Menkul Kıymetleştirme Şirketi Fibabanka Beşinci Varlık Finansmanı Fonu	07/01/25	5	TRPTM5F12539	51,00		12.300.000,00	93,837600	21/11/24	63,877709				99,325640	12.217.053,70	0,38	0,12	0,12
TRPFB3F12517	TL	FIBABANKA UÇUNCU VARLIK FİNANSMANI FONU (VFF)	16/01/25	14	TRPFB3F12517	53,50		3.200.000,00	78,850000	17/07/24	60,632227				98,198544	3.142.353,40	0,10	0,03	0,03
TRPTM5F12547	TL	Türkiye Menkul Kıymetleştirme Şirketi Fibabanka Beşinci Varlık Finansmanı Fonu	21/01/25	19	TRPTM5F12547	51,00		3.500.000,00	93,837600	05/12/24	63,877709				97,461527	3.411.153,45	0,11	0,03	0,03
TRPTM5F22546	TL	Türkiye Menkul Kıymetleştirme Şirketi Fibabanka Beşinci Varlık Finansmanı Fonu	13/02/25	42	TRPTM5F22546	50,75		18.900.000,00	92,776200	19/12/24	63,021062				94,531693	17.866.489,95	0,55	0,17	0,17
TRPFBA122528	TL	FIBABANKA A.Ş. ARENA BİLGİSAYAR BİRİNCİ VARLIK FİNANSMANI FONU	20/02/25	49	TRPFBA122528	50,75		18.890.000,00	92,896000	27/12/24	63,073522				93,645788	17.689.689,37	0,55	0,17	0,17
TRPTM5F32529	TL	Türkiye Menkul Kıymetleştirme Şirketi Fibabanka Beşinci Varlık Finansmanı Fonu	19/03/25	76	TRPTM5F32529	50,00		14.100.000,00	89,024400	19/12/24	60,239223				90,649039	12.781.514,44	0,39	0,12	0,12
TRPTM5F52527	TL	Türkiye Menkul Kıymetleştirme Şirketi Fibabanka Beşinci Varlık Finansmanı Fonu	22/05/25	140	TRPTM5F52527	49,50		15.000.000,00	82,723300	19/12/24	56,759075				84,162035	12.624.305,26	0,39	0,12	0,12
GRUP TOPLAMI								112.640.000,00								108.017.275,18	3,35	1,03	1,03
GRUP TOPLAMI								3.087.539.816,00								3.235.998.027,31	100,00	30,35	30,54

