

**TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK
YATIRIM FONU**

**31 ARALIK 2022 HESAP DÖNEMİNE AİT
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.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP 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. Pera 2 Değişken Grup 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 2022 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, 27 Nisan 2023

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER

SAYFA

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

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Nominal		Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Aış Fiyatı	Satın Aış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük		Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
			Menkul Oranı	Faiz Ödeme Sayısı						Birim	Günlük			
HİSSE SENETLERİ														
HİSSE TÜRK														
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYİ A.Ş.	-	AEFES	-	9.000,00	54,42	18/11/22	-	-	67,75	-	609.750,00	2,76	1,41
	AKBANK	-	AKBNK	-	57.500,00	11,87	09/12/22	-	-	19,55	-	1.124.125,00	5,09	2,59
	AKFEN GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	-	AKFGY	-	115.000,00	5,27	09/12/22	-	-	5,28	-	607.200,00	2,75	1,40
	ARSAN	-	ARSAN	-	0,03	3,67	28/09/22	-	-	13,19	-	0,40	-	-
	BIMAS	-	BIMAS	-	5.600,00	112,50	09/12/22	-	-	136,90	-	766.640,00	3,47	1,77
	CCOLA	-	CCOLA	-	3.750,00	177,45	09/12/22	-	-	204,40	-	766.500,00	3,47	1,77
	DOĞUŞ OTOM.SERVİS VE TİC.A.Ş.	-	DOAS	-	3.500,00	155,70	25/11/22	-	-	196,00	-	686.000,00	3,10	1,58
	DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU HOLD.A.Ş.	-	DOHOL	-	102.000,00	6,97	09/12/22	-	-	10,58	-	1.079.160,00	4,88	2,49
	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	FROTO	-	1.600,00	319,92	05/10/22	-	-	524,50	-	839.200,00	3,80	1,93
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	GARAN	-	41.000,00	26,81	16/12/22	-	-	30,04	-	1.231.640,00	5,57	2,84
	GALATA WIND ENERJİ A.Ş.	-	GWIND	-	25.000,00	23,18	30/12/22	-	-	22,76	-	569.000,00	2,58	1,31
	T.IS BANKASI	-	ISCTR	-	0,40	9,23	14/11/22	-	-	12,77	-	5,11	-	-
	KOÇ HOLDING A.Ş.	-	KCHOL	-	9.000,00	38,44	09/12/22	-	-	83,70	-	753.300,00	3,41	1,74
	KOZA ANADOLU METAL MAD.İŞL.A.Ş.	-	KOZAA	-	13.000,00	32,44	13/12/22	-	-	53,60	-	696.800,00	3,15	1,60
	KARDEMİR KARABÜK DEM.ÇELİK	-	KRDMD	-	34.000,00	17,05	13/12/22	-	-	17,99	-	611.660,00	2,77	1,41
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	5.400,00	45,45	04/11/22	-	-	132,20	-	713.880,00	3,23	1,65
	MİGROS TİC.A.Ş.	-	MGROS	-	4.400,00	130,91	13/12/22	-	-	146,50	-	644.600,00	2,92	1,48
	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	-	PGSUS	-	2.400,00	188,58	09/12/22	-	-	480,00	-	1.152.000,00	5,21	2,65
	SABANCI HOLDING A.Ş.	-	SAHOL	-	32.000,00	31,32	13/12/22	-	-	45,08	-	1.442.560,00	6,53	3,32
	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	-	SISE	-	15.000,07	28,91	09/12/22	-	-	42,92	-	643.803,00	2,91	1,48
	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.	-	TCELL	-	14.000,00	27,94	09/12/22	-	-	37,88	-	530.320,00	2,40	1,22
	EUROPAP TEZOL KAĞIT SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	TEZOL	-	10.000,00	29,97	09/12/22	-	-	29,44	-	294.400,00	1,33	0,68
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	9.500,00	66,53	13/12/22	-	-	140,90	-	1.338.550,00	6,06	3,08
	TOASO	-	TOASO	-	8.000,00	100,57	04/11/22	-	-	165,70	-	1.325.600,00	6,00	3,05
	TOASO	-	TOASO	-	(100,00)	100,57	30/12/22	-	-	165,70	-	(16.570,00)	(0,07)	(0,04)
	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	TTKOM	-	35.000,00	13,34	09/12/22	-	-	24,56	-	859.600,00	3,89	1,98
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	2.800,00	282,73	13/12/22	-	-	529,90	-	1.483.720,00	6,72	3,42
	VESTL	-	VESTL	-	8.500,00	66,85	09/12/22	-	-	71,25	-	605.625,00	2,74	1,40
	YAPI KREDİ BANK	-	YKBNK	-	0,12	7,17	25/11/22	-	-	11,81	-	1,42	-	-
ARA GRUP TOPLAMI					566.850,62							21.359.069,93	96,67	49,21

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük	Toplam	Grup Toplam		
				Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutarı	Birim Günlük Deger Kur			Deger (%)	(%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Yabancı															
		iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	IDTL	-	-	10.600,00	3,59	02/11/22	-	-	3,72	-	736.419,46	3,33	1,70
ARA GRUP TOPLAMI						10.600,00							736.419,46	3,33	1,70
GRUP TOPLAMI						577.450,62							22.095.489,39	100,00	50,91
BORÇLANMA SENETLERİ															
Özel Sektör Tahvil															
		ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	TRSENSA22315	-	-	790.000,00	100,00	23/02/21	-	-	100,88	-	796.944,51	22,98	1,84
		KOÇ FİNANSMAN	TRSKCTF22312	-	-	670.000,00	100,00	26/02/21	-	-	100,32	-	672.166,11	19,38	1,55
		AYGAZ A.Ş.	TR SAYGZ62318	-	-	105.000,00	100,00	02/07/21	-	-	98,95	-	103.900,18	3,00	0,24
		ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYİ A.Ş.	TRSEFES12413	-	-	1.110.000,00	100,00	22/12/22	-	-	100,85	-	1.119.489,59	32,26	2,58
		ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	TRSENSAE2429	-	-	240.000,00	100,00	21/10/22	-	-	105,29	-	252.697,14	7,29	0,58
		VAKIF BANK	TRSVKFB92719	-	-	500.000,00	100,00	18/09/17	-	-	100,44	-	502.218,79	14,48	1,16
ARA GRUP TOPLAMI						3.415.000,00							3.447.416,32	99,39	7,95
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet															
		Türkiye Kalkınma ve Yatırım Bankası A.Ş. Varlık Finansmanı Fonu	TRPKYVFA2318	-	-	10.000,00	100,00	31/12/21	-	-	100,62	-	10.061,75	0,29	0,02
ARA GRUP TOPLAMI						10.000,00							10.061,75	0,29	0,02
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
		HAZINE	TRD031225T10	-	-	10.000,00	90,63	31/12/21	-	-	110,88	-	11.088,15	0,32	0,03
ARA GRUP TOPLAMI						10.000,00							11.088,15	0,32	0,03
GRUP TOPLAMI													3.468.566,22	100,00	8,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	
				Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutarı	Birim Deger				Günlük Kur
MEVDUAT															
	VAKIF BANK	02/01/23	VAKIF BANK	-	-	2.512.767,13	-	30/12/22	-	-	20,00	-	2.516.897,71	50,05	5,78
	HALK BANKASI	02/01/23	HALK BANKASI	-	-	2.508.780,01	-	30/12/22	-	-	13,00	-	2.511.460,63	49,95	5,79
GRUP TOPLAMI						5.021.547,14						5.028.358,34	100,00	11,57	
TPP															
	TPP	02/01/23	TPP	-	-	2.302.287,40	12,10	30/12/22	-	-	11,35	-	2.302.287,40	100,00	5,30
GRUP TOPLAMI						2.302.287,40						2.302.287,40	100,00	5,30	
DİĞER															
Borsa Y. Fonu Yabancı															
	JPMORGAN BETABÜİLDERS US TREASURY BOND 0-1 YR UCITS	-	BBIL	-	-	280,00	102,46	06/12/22	-	-	102,71	-	537.740,67	19,45	1,24
	iShares Short Treasury Bond	-	SHV	-	-	525,00	109,87	06/12/22	-	-	109,92	-	1.079.041,50	39,02	2,49
	ISHARES 20+ YEAR TREASURY BOND ETF	-	TLT	-	-	610,00	94,03	02/11/22	-	-	100,67	-	1.148.238,30	41,53	2,65
GRUP TOPLAMI						1.415,00						2.765.020,47	100,00	6,38	
VIOP NAKİT TEMİNATI															
	VIOP Nakit Teminatı	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	4.847.551,18	-	-	-	-	-	-	4.847.551,18	100,00	11,17
GRUP TOPLAMI						4.847.551,18						4.847.551,18	100,00	11,17	
VIOP USD NAKİT TEMİNATI															
	VIOP USD Nakit Teminatı	-	VIOP USD Nakit Teminatı	-	-	154.858,67	-	-	-	-	-	-	2.895.593,87	100,00	0,36
GRUP TOPLAMI						154.858,67						2.895.593,87	100,00	0,36	
DİĞER															
Döviz															
	ABD HAZİNE	-	USD	-	-	154.962,96	18,43	30/12/22	-	-	18,70	-	2.897.543,91	-	-
GRUP TOPLAMI						154.962,96						2.897.543,91	0,00	0,00	
FON PORTFÖY DEĞERİ												43.402.866,87	100,00		

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2022 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ (Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2022		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A) FON PORTFÖY DEĞERİ	43.402.866,87		99,70
B) HAZIR DEĞERLER	123.263,39	-	0,28
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	123.263,39	100,00	0,28
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C) ALACAKLAR	833.086,03	-	1,91
a) Takastan Alacaklar	678.260,00	100,00	1,56
i) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	678.260,00	100,00	1,56
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	154.826,03	-	0,36
i) Diğer Alacaklar	154.826,03	-	0,36
D) BORÇLAR	(827.548,16)	-	(1,90)
a) Takasa Borçlar	(579.500,00)	70,03	(1,33)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	(579.500,00)	-	-
iii) İhbarlı FonPay Takas	(22.228,19)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(28.036,12)	3,39	(0,06)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Diğer Borçlar	(196.477,74)	23,90	(0,45)
i) Diğer Borçlar	(195.003,48)	-	(0,45)
ii) Denetim Reeskontu	(1.474,26)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(1.306,11)	0,16	-
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	43.531.668,13		100,00
Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000		
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	99.010.083.987,437		
Fon toplam değeri (TL)	43.531.668,130		
Dolaşımdaki pay sayısı	989.916.012,563		
Birim pay değeri (TL)	0,043975		