

**HALK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**31 ARALIK 2019 TARİHLİ HESAP
DÖNEMİNE AİT FİYAT RAPORU**

HALK HAYAT EMEKLİLİK A.Ş. KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI 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

Halk Hayat Emeklilik A.Ş. Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2019 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 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Halk Hayat Emeklilik A.Ş. Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2019 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, Fon Kurulu ve Halk Hayat Emeklilik A.Ş.'nin 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

Müjde Aslan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 27 Nisan 2020

	TUTAR (TL)	% GRUP	% TOPLAM
A. FON ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	553.321.057	%0,00	%99,68
B. HAZIR DEĞERLER (+)	39.902	%100,00	%0,01
a) Kasa	-	%0,00	%0,00
b) Bankalar	7	%0,02	%0,00
c) Diğer Hazır Değerler	39.896	%99,98	%0,01
C. ALACAKLAR	117.462	%100,00	%0,02
a) Takaslan Alacaklar Toplamı	-	%0,00	%0,00
i) T1 Alacakları	-		%0,00
ii) T2 Alacakları			%0,00
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları			%0,00
b) Diğer Alacaklar	117.452	%100,00	%0,02
i) Diğer Alacaklar			%0,00
ii) Vergi Alacakları	-		%0,00
iii) Mevduat Alacakları	-		%0,00
iv) Temettü	-		%0,00
D. BORÇLAR (-)	1.728.186	%100,00	%0,31
a) Takasa Borçlar	879.423	%50,89	%0,16
i) T1 Borçları	-		%0,00
ii) T2 Borçları	-		%0,00
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-		%0,00
iv) İhbarlı FonPay Takas	879.423		%0,00
b) Yönetim Ücreti	825.912	%47,79	%0,15
c) Ödenecek Vergi	-	%0,00	%0,00
d) İhtiyatlar	-	%0,00	%0,00
e) Diğer borçlar	6.297	%0,36	%0,00
i) Diğer Borçlar	735	%0,04	%0,00
ii) Denetim Reeskontu	5.562	%0,32	%0,00
f) Kayda Alma Ücreti	16.554	%0,96	%0,00
g) Krediler	-	%0,00	%0,00
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	551.750.225		
Toplam Katılma Payı Pay Sayısı	500.000.000.000		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma Payı	484.922.627.502		

HHG-KAMU DIŞ BORÇLANIMA ARAÇLARI EYE.

MEVHUL KURUM	DOVE CİNEİ	İRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TERSİMAT TUTARI	NET ÖNÖR TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
BORÇLANIMA																	
Eurobond Türk																	
XIS08002347072	USD	HALK BANKASI	05/02/20		32,08		1.000.000,00	89,181000	20/09/18	0,000000				6.038.032,35	1,34	1,08	
US0800122A387	USD	HAZİNE	05/09/20		4,75		5.700.000,00	102,860000	25/09/18	0,000000				34.888.860,78	7,11	6,27	1,09
XS11800702081	USD	HALK BANKASI	11/02/21		27,45		1.000.000,00	81,187000	20/09/18	0,000000				5.875.860,00	1,20	1,08	8,29
US0800122B426	USD	HAZİNE	30/03/21		6,78		9.100.000,00	101,000000	28/05/18	0,000000				59.480.951,91	11,37	10,28	10,24
XIS0800185389	EUR	HAZİNE	12/11/21		2,13		80.000,00	110,887800	05/01/18	0,000000				424.837,84	0,08	0,08	0,08
XIS1571389754	USD	YAPI KREDİ BANKASI	24/02/22		4,07		500.000,00	103,879700	05/09/17	0,000000				3.003.675,62	0,62	0,68	0,89
XIS1623035379	USD	TÜRKİYE VAĞFULAR BANKASI T.A.O	30/05/23		4,94		500.000,00	103,715600	05/09/17	0,000000				2.980.771,44	0,61	0,54	0,54
US0800122B327	USD	HAZİNE	26/09/23		4,48		2.800.000,00	110,327000	28/02/18	0,000000				17.888.515,46	3,83	3,26	3,21
US0800122C488	USD	HAZİNE	23/03/23		4,11		2.100.000,00	94,728000	05/01/18	0,000000				12.112.344,08	2,46	2,16	2,20
US0800122C391	USD	HAZİNE	25/11/23		8,32		4.800.000,00	102,881700	11/03/18	0,000000				29.026.671,30	5,95	5,25	5,25
US0800122C393	USD	HAZİNE	22/03/24		8,30		3.800.000,00	104,775800	05/07/18	0,000000				22.259.088,74	4,58	4,02	4,02
US0800122A405	USD	HAZİNE	05/02/25		8,80		3.800.000,00	119,443000	23/07/18	0,000000				28.838.860,85	5,46	4,81	4,83
XS1628018415	EUR	HAZİNE	18/06/25		4,18		8.000.000,00	89,571000	08/07/18	0,000000				40.598.113,88	8,32	7,35	7,38
US0800122C178	USD	HAZİNE	14/04/28		5,02		1.000.000,00	88,188400	30/10/17	0,000000				5.807.183,45	1,19	1,01	1,02
US0800122C122	USD	HAZİNE	25/03/27		5,07		3.000.000,00	108,487200	09/09/17	0,000000				18.380.817,25	3,77	3,32	3,32
US0800122C398	USD	HAZİNE	09/05/28		5,82		2.800.000,00	88,253400	28/03/18	0,000000				18.287.953,02	3,32	2,94	2,95
US0800122A140	USD	HAZİNE	15/01/30		6,02		3.170.000,00	188,074800	20/04/18	0,000000				27.889.280,17	5,74	5,08	5,07
US0800122A178	USD	HAZİNE	14/02/34		6,80		3.800.000,00	121,870000	08/02/18	0,000000				25.185.891,12	5,18	4,56	4,59
US0800122A180	USD	HAZİNE	17/03/38		5,72		2.800.000,00	112,030300	05/01/18	0,000000				12.514.880,44	2,37	2,08	2,07
US0800122B658	USD	HAZİNE	08/03/38		5,75		1.400.000,00	119,822800	05/01/18	0,000000				8.048.480,44	1,86	1,64	1,64
US0800122B048	USD	HAZİNE	30/05/40		5,82		2.800.000,00	101,688300	28/12/17	0,000000				18.181.370,83	3,31	2,92	2,93
US0800122B384	USD	HAZİNE	14/01/41		6,58		3.600.000,00	100,780800	28/12/18	0,000000				20.573.180,00	4,22	3,72	3,73
US0800122C840	USD	HAZİNE	18/04/43		5,70		1.000.000,00	80,194600	05/01/18	0,000000				4.872.589,35	1,02	0,90	0,90
US0800122C037	USD	HAZİNE	17/02/45		7,71		3.800.000,00	93,798800	17/11/18	0,000000				23.884.104,00	4,88	4,28	4,28
US0800122C405	USD	HAZİNE	13/05/47		7,58		4.500.000,00	81,747800	12/12/18	0,000000				24.175.548,38	4,88	4,37	4,38
GRUP TOPLAMI							73.800.000,00							482.459.722,17	94,80	83,57	83,82
Özel Sektör																	
Özel Sektör Tahvil																	
TR00TYF42518	TL	Türkiye Kalkınma ve Yatırım Bankası A.Ş.	07/11/23		18,88		9.000.000,00	100,000000	07/11/18	14,574804				9.848.585,79	2,04	1,80	1,80
TR00SKK42716	TL	SHOKK	10/11/27		0,02		5.500.000,00	101,852000	08/11/18	18,883241				5.503.403,04	1,11	0,88	0,88
GRUP TOPLAMI							14.500.000,00							15.352.088,83	3,15	2,78	2,78
GRUP TOPLAMI							88.100.000,00							477.802.713,00	97,95	86,35	86,60
T.REPO																	
TRT050024119	TL	HAZİNE	02/01/20		11,50		10.000.301,37	11,500000	31/11/18		10.001.200,00	10.000.301,37					1,81
TRT080121118	TL	HAZİNE	02/01/20		11,50		8.505.368,16	11,500000	31/11/18		8.512.415,00	8.505.368,16					1,54
TRT070727113	TL	HAZİNE	02/01/20		11,50		11.507.246,58	11,500000	31/11/18		8.802.775,00	11.507.246,58					2,08
TRT140022717	TL	HAZİNE	02/01/20		11,50		5.503.485,75	11,500000	31/11/18		5.877.780,00	5.503.485,75					1,00
TRT220011118	TL	HAZİNE	02/01/20		11,50		14.508.138,89	11,500000	31/11/18		15.082.225,00	14.508.138,89					2,63
GRUP TOPLAMI							50.031.508,85							60.918.786,84	100,00	9,04	9,06
GRUP TOPLAMI							50.031.508,85							60.918.786,84	100,00	9,04	9,06
MEVDUAT																	
HALK BANKASI	TL	HAZİNE	02/01/20		10,75		12.954.000,00		29/11/18			12.887.258,90		12.883.954,74	81,23	2,27	2,28
HALK BANKASI	USD	HAZİNE	02/01/20		1,00		185.000,00		25/11/18			180.040,52		1.088.110,58	7,10	0,20	0,20
HALK BANKASI	USD	HAZİNE	03/01/20		1,00		304.188,04		27/11/18			304.254,31		1.807.171,88	11,87	0,33	0,33
GRUP TOPLAMI							13.043.188,04							15.489.234,91	100,00	2,80	2,81
GRUP TOPLAMI							13.043.188,04							15.489.234,91	100,00	2,80	2,81
TPP																	
TPP																	
GRUP TOPLAMI							12.007,07	10,750000	31/11/18			12.007,07		12.003,83	100,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							12.007,07	12.887,87						12.883,83	100,00	0,00	0,00

[illegible]