

**Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu
Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım
Fonu**

**31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla sona eren hesap
dönemine ait fiyat raporu**



**Building a better
working world**

Güney Bağımsız Denetim ve SMMM A.Ş.
Maslak Mah. Eski Büyükdere Cad.
Orjin Maslak İş Merkezi No: 27
Kat: 2-3-4 Daire: 54-57-59
34485 Sarıyer
İstanbul - Türkiye

Tel: +90 212 315 3000
Fax: +90 212 230 8291
ey.com
Ticaret Sicil No : 479920
Mersis No: 0-4350-3032-6000017

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun 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

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 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) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.
A member firm of Ernst&Young Global Limited



Fatih Polat, SMMM
Sorumlu Denetçi

26 Nisan 2021
İstanbul, Türkiye

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALİŞ 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																		
Eurobond Türk																		
XS110995 9467	EUR	ARÇELİK A.Ş.	16/09/21		10,00		300.000,00	104,374700	05/06/20	0,000000				103,052842	2.818.412,79	0,29	0,26	0,26
XS099315 5398	EUR	HAZİNE	12/11/21		4,27		16.790.000,00	103,927300	23/12/20	0,000000				103,598973	158.573.100,23	16,57	14,74	14,80
XS105734 0009	EUR	HAZİNE	11/04/23		0,77		19.348.000,00	101,806100	18/06/20	0,000000				107,693062	189.953.445,29	19,85	17,65	17,73
XS195864 9854	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/10/24		1,95		500.000,00	111,247900	10/01/20	0,000000				111,764750	4.146.136,93	0,43	0,38	0,39
XS184344 3356	EUR	HAZİNE	31/03/25		2,70		26.237.000,00	100,717800	16/11/20	0,000000				109,641589	262.248.413,10	27,40	24,36	24,47
XS162991 8415	EUR	HAZİNE	14/06/25		1,33		13.818.000,00	94,837400	10/11/20	0,000000				103,169822	129.963.453,03	13,58	12,08	12,13
XS190918 4753	EUR	HAZİNE	16/02/26		3,74		20.280.000,00	102,804700	05/11/20	0,000000				113,294240	209.459.062,43	21,88	19,47	19,55
GRUP TOPLAMI							97.273.000,00								957.162.023,80	100,00	88,94	89,33

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALİŞ 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)
GRUP TOPLAMI								97.273.000,00							957.162.023,80	100,00	88,94	89,33
T.REPO																		
TRT08032 8T15	TL	HAZİNE	04/01/21		17,95		27.053.112,33	17,950000	31/12/20		27.024.740 ,00	73729842131 7126654	27.053.112,33	17,950000	27.013.268,30	98,54	2,51	2,52
TRT16042 5T33	TL	HAZİNE	04/01/21		11,06		110.133,33	11,060000	31/12/20		110.960,00	73729842131 7117477	110.133,33	11,060000	110.033,32	0,40	0,01	0,01
TRT16042 5T33	TL	HAZİNE	04/01/21		11,06		290.351,50	11,060000	31/12/20		292.525,00	73729842131 7117476	290.351,50	11,060000	290.087,84	1,06	0,03	0,03
GRUP TOPLAMI								27.453.597,16							27.413.389,46	100,00	2,55	2,56
GRUP TOPLAMI								27.453.597,16							27.413.389,46	100,00	2,55	2,56

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KİYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	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)
KATILIM HESABI																		
KATILIM HESABI																		
ALBARAK A TÜRK KATILIM BANKASI A.Ş.	EUR		26/01/21		2,50		3.000.000,00		23/12/20				3.006.967,21	2,500000	27.366.013,01	100,00	2,54	2,55
GRUP TOPLAMI							3.000.000,00								27.366.013,01	100,00	2,54	2,55
GRUP TOPLAMI							3.000.000,00								27.366.013,01	100,00	2,54	2,55
DİĞER																		
Y.Fonu Türk																		
IAG-İŞ PORTFÖY ALTYAPI GSYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					11.974.009,00	1,376429	16/12/20					1,676544	20.074.952,94	37,63	1,87	1,87
IIK-İŞ PORT. YÖ N.A.Ş. QUASAR İST.KONU T KATILIM GYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					6.353.000,00	1,000000	03/04/19					1,145757	7.278.994,22	13,64	0,68	0,68
ISZ-İŞ PORTFÖY BİRİNCİ GYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					16.559.004,00	1,077612	02/07/19					1,419664	23.508.221,85	44,07	2,19	2,19
IYG-İŞ PORTFÖY YENİLENE BİLİR ENERJİ GSYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					2.362.241,00	1,015984	17/07/20					1,053363	2.488.297,27	4,66	0,23	0,23
GRUP TOPLAMI							37.248.254,00								53.350.466,28	100,00	4,97	4,97
GRUP TOPLAMI							37.248.254,00								53.350.466,28	100,00	4,97	4,97
TÜREV																		
Futures																		
Kısa																		

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALİŞ 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)
F_EURTR Y0121	TL						1.500,00	9,165200	29/12/20			80176126726 472720		9,221900	13.832.850,00	0,00	0,00	0,00
F_USDTR Y0121	TL						520,00	7,430400	29/12/20			80176126726 306660		7,507500	3.903.900,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							2.020,00								17.736.750,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							2.020,00								17.736.750,00	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																		
VIOP Nakit Teminatı															10.755.983,19	100,00	1,00	
GRUP TOPLAMI							10.755.983,19								10.755.983,19	100,00	1,00	
GRUP TOPLAMI							10.755.983,19								10.755.983,19	100,00	1,00	
DİĞER																		
Döviz																		
EUR	EUR	EU					138.211,89	9,334438	31/12/20					9,116400	1.259.994,87	0,00	0,00	0,12
USD	USD	FED					31.415,64	7,755200	31/12/20					7,419400	233.085,20	0,00	0,00	0,02
GRUP TOPLAMI							169.627,53								1.493.080,07	0,00	0,00	0,14
GRUP TOPLAMI							169.627,53								1.493.080,07	0,00	0,00	0,14
FON PORTFÖY DEĞERİ															1.076.047.875,74			100,00

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu**31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu**
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

	31 Aralık 2020			31 Aralık 2019		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	1.076.047.875	100,00	100,41	667.342.086	100,00	97,22
B. HAZIR DEĞERLER (+)	1.503.387	100,00	0,14	21.878.515	100,00	3,19
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	10.307	0,69	-	3.688	0,02	-
c) Diğer Hazır Değerler	1.493.080	99,31	0,14	21.874.826	99,98	3,19
C.ALACAKLAR (+)	1.300.267	86,49	0,12	36.982	0,17	0,01
a) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	1.300.267	86,49	0,12	36.982	0,17	0,01
D. BORÇLAR (-)	7.212.721	479,76	0,67	2.824.677	12,91	0,41
a) Takasa Borçlar	5.455.163	362,86	0,51	1.799.627	8,23	0,26
b) Yönetim Ücreti	1.722.726	114,58	0,16	1.023.147	4,67	0,15
c) Diğer Borçlar	2.683	0,18	-	1.903	0,01	-
f) Kayda Alma Ücreti	32.149	2,14	-	-	-	-
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	1.071.638.808		100	686.432.906		100