

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş.
OKS Temkinli Değişken Emeklilik
Yatırım Fonu

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

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken 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. OKS Temkinli Değişken 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. OKS Temkinli Değişken 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. OKS Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu (Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

Menkul Kıymet	Döviz Cinsi	Hisseyi Kullanan Kurum	Vade Tarihi	Vadeye Kalan Gün	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Iskonto Oranı (%)	Bono Teminat Tutarı	Borsa Sözleşme No	Net Donuş Tutarı	Günlük Br Değer	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (FPO Göre)	Toplam (FTD Göre)
HİSSE SENETLERİ																		
Hisse Türk																		
ANSOR	TL	ANADOLU ANONİM TÜRK SİGORTA ŞİRKETİ					26.401,00	5,174911	27/05/20			801005118049809870		7,550000	188.327,55	100,00	3,95	4,00
GRUP TOPLAMI																		
							26.401,00								188.327,55	100,00	3,95	4,00
GRUP TOPLAMI																		
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvil																		
TRT170221T12	TL	HAZINE	17/02/21		0,00		295.000,00	97,267800	30/03/20	15,070877		726372849149474029		103,462793	305.215,24	9,65	6,05	6,13
TRT210421T14	TL	HAZINE	21/04/21		0,00		150.000,00	114,852500	23/12/19	15,490503		722493772126366370		105,759713	158.638,07	5,02	3,15	3,19
TRT090621T18	TL	HAZINE	09/06/21		0,00		100.000,00	87,456500	08/04/20	16,070767		726729640572468898		93,714256	93.714,26	2,97	1,86	1,88
TRT220921T18	TL	HAZINE	22/09/21		0,00		150.000,00	97,801600	31/03/20	16,437280		726412706445672622		98,142914	147.214,37	4,66	2,92	2,96

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun

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 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)
TRT260122T11	TL	HAZINE	26/01/22		9,97		200.000,00	100,075000	29/01/20	16,320422				102,999645	205.999,29	6,52	4,08	4,14
TRT020322T17	TL	HAZINE	02/03/22		0,00		80.000,00	105,089500	01/06/20	15,680596		728748069143673460		99,391680	79.513,34	2,52	1,58	1,60
GRUP TOPLAMI							975.000,00								990.294,57	31,34	19,64	19,90
Özel Sektör																		
Finansman Borosu																		
TRFAKBK121B7	TL	AKBANK T.A.Ş.	14/01/21		9,94		50.000,00	100,000000	26/06/20	20,304832				100,855118	50.477,56	1,60	1,00	1,01
TRFYKBK12122	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/21		9,25		100.000,00	95,426900	10/07/20	15,973778				99,433197	99.433,20	3,15	1,97	2,00
TRFAKBK12148	TL	AKBANK T.A.Ş.	20/01/21		9,40		60.000,00	94,569000	11/06/20	16,563641				99,203345	59.523,21	1,88	1,18	1,20
TRFYKBK12130	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	29/01/21		9,25		80.000,00	85,268000	17/07/20	19,447671				98,646009	78.916,81	2,50	1,57	1,58

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun

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 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)
TRFYK22139	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	05/02/21		9,25		50.000,00	95,265000	24/07/20	12,388519				98,886328	49.443,16	1,56	0,98	0,99
TRFDZBK22149	TL	DENİZBANK A.Ş.	16/02/21		11,48		136.281,00	94,556000	17/06/20	11,807426				98,603282	134.377,54	4,25	2,66	2,70
TRFTBK32123	TL	TÜRK EKONOMİ BANKASI A.Ş.	12/03/21		9,40		100.000,00	100,000000	12/06/20	9,764618				100,537467	100.537,47	3,18	1,99	2,02
TRFTBK32131	TL	TÜRK EKONOMİ BANKASI A.Ş.	19/03/21		9,40		50.000,00	100,000000	19/06/20	19,250317				98,618417	49.309,21	1,56	0,98	0,99
TRFKCTF42119	TL	KOÇ FİNANSMAN A.Ş.	21/04/21		9,50		75.000,00	92,757000	25/06/20	9,579216				97,280797	72.960,60	2,31	1,45	1,47
TRFHSBC52115	TL	HSBC BANK A.Ş.	05/05/21		15,00		80.000,00	92,055000	07/10/20	19,423927				94,147775	75.318,22	2,38	1,49	1,51
GRUP TOPLAMI							781.281,00								770.295,98	24,37	15,27	15,47
Özel Sektör Tahvil																		
TRSBOLU12115	TL	BOLU ÇİMENTO SANAYİİ A.Ş.	11/01/21		26,54		20.000,00	100,000000	14/01/19	16,697540				103,442354	20.688,47	0,65	0,41	0,42
TRSTPRS12115	TL	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL Rafinerileri A.Ş.	22/01/21		25,29		60.000,00	100,000000	25/01/19	20,789948				102,587083	61.552,25	1,95	1,22	1,24
TRISGY12113	TL	İS GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	25/01/21		26,51		30.000,00	100,000000	28/01/19	16,981468				102,864421	30.889,33	0,98	0,61	0,62
TRSTPRS2114	TL	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL Rafinerileri A.Ş.	05/02/21		24,70		20.000,00	100,000000	08/02/19	18,654137				102,530593	20.506,12	0,65	0,41	0,41
TRSBARCL22117	TL	ARÇELİK A.Ş.	12/02/21		24,69		50.000,00	100,000000	15/02/19	15,969009				102,481448	51.240,72	1,62	1,02	1,03
TRSBOPAS22129	TL	OPET PETROL CÜLÖK A.Ş.	19/02/21		24,81		100.000,00	100,000000	22/02/19	18,786488				101,898737	101.898,74	3,23	2,02	2,05
TRSHKFT32123	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.	10/03/21		19,05		40.000,00	100,000000	13/03/19	18,993655				101,101852	40.440,74	1,28	0,80	0,81

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRACCI KURUM	VADE TARİHİ	VADYE 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)
TRSCMB32112	TL	ÇİMSA ÇİMENTO SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	18/03/21		24,87		30.000,00	100,000000	21/03/19	18,410807				100,899711	30.209,91	0,96	0,60	0,61
TRSIGV32111	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	23/03/21		15,88		10.000,00	100,000000	27/03/18	16,979151				100,442811	10.044,28	0,32	0,20	0,20
TRSDVA52118	TL	DEVA HOLDİNG A.Ş.	04/05/21		0,00		10.000,00	102,798200	04/10/18	18,272850		704879505494507963		103,530922	10.353,09	0,33	0,21	0,21
TRSERGL52117	TL	EPEĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.	28/05/21		26,89		30.000,00	100,000000	31/05/19	17,808305				101,604223	30.481,27	0,96	0,60	0,61
TRSKFT62113	TL	KOÇ FİAT KREDİ FİNANSMAN A.Ş.	10/06/21		27,45		30.000,00	100,000000	13/06/19	18,172564				101,022089	30.306,63	0,96	0,60	0,61
TRSA5LN62118	TL	Aslan Çimento A.Ş.	18/06/21		26,55		30.000,00	100,000000	21/06/19	18,253965				100,645164	30.183,55	0,96	0,60	0,61
TRSAVG262110	TL	AYGAZ A.Ş.	18/06/21		25,78		30.000,00	100,000000	21/06/19	18,017359				100,641466	30.192,44	0,96	0,60	0,61
TRSBOLU72119	TL	BOLU ÇİMENTO SANAYİİ A.Ş.	05/07/21		24,09		100.000,00	100,000000	08/07/19	14,645715				103,362936	103.362,94	3,27	2,05	2,08
TRSKCTF72127	TL	KOÇ FİNANSMAN A.Ş.	14/07/21		23,15		40.000,00	100,000000	17/07/19	16,678915				102,704122	41.081,65	1,30	0,81	0,83
TRSMGT72110	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	14/07/21		23,61		10.000,00	100,000000	19/07/18	18,974586				103,796529	10.379,65	0,33	0,21	0,21
TRSRCL72112	TL	ARÇELİK A.Ş.	16/07/21		21,97		50.000,00	100,000000	24/07/19	15,682463				102,911253	51.455,83	1,63	1,02	1,03
TRSAVG282118	TL	AYGAZ A.Ş.	04/08/21		19,39		60.800,00	100,000000	07/08/19	17,631850				102,839322	61.563,59	1,95	1,22	1,24
TRSAIGV92113	TL	AKİŞ GYO A.Ş.	08/09/21		19,69		60.000,00	100,000000	11/09/19	19,282203				101,981491	61.188,89	1,94	1,21	1,23
TRSDZBK12226	TL	DENİZBANK A.Ş.	21/01/22		10,65		75.000,00	85,912009	08/07/20	10,364604				90,120450	67.590,34	2,14	1,34	1,36
TRSAKFH22112	TL	AKFEN HOLDİNG A.Ş.	04/02/22		12,96		50.000,00	100,000000	07/02/20	15,392978				101,080646	50.543,32	1,60	1,00	1,02
TRSYAZI52116	TL	AG ANADOLU GRUBU HOLDİNG	11/05/22		10,24		100.000,00	100,000000	13/05/20	16,479884				102,174670	102.174,67	3,23	2,03	2,05
TRSMGT62228	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	08/06/22		10,12		90.000,00	100,000000	10/06/20	15,326524				100,008412	90.817,57	2,87	1,80	1,82
TRSTPRSK2217	TL	TOPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	28/11/22		2,00		70.000,00	100,000000	30/11/20	18,803504		705037925523747895		101,465598	71.025,92	2,25	1,41	1,43
TRSTISB127112	TL	T.İŞ BANKASI A. S.	27/07/27		0,00		30.000,00	104,033500	09/10/18	16,275833				103,072067	30.321,63	0,98	0,61	0,62
TRSTISB62911	TL	T.İŞ BANKASI A. S.	06/06/29		27,61		40.000,00	100,000000	19/06/19	18,371700				100,949132	40.379,65	1,28	0,80	0,81
TRSGRAN23013	TL	GARANTİ BANKASI A.Ş.	14/02/30		8,00		35.000,00	100,000000	14/02/20	19,185713				105,160543	36.806,19	1,16	0,73	0,74
GRUP TOPLAMI							1.300.000,00								1.318.309,18	41,74	26,14	26,61
GRUP TOPLAMI							2.081.281,00								2.088.606,16	66,11	41,41	41,96
GRUP TOPLAMI							3.058.281,00								3.078.900,73	97,45	61,05	61,86

(5)

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu (Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MEVDUAT	MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SIKLIĞI	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)
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL			06/01/21		16,75		84.664,76		01/12/20				86.060,31	16,750000	85.865,21	8,51	1,70	1,72
TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	TL			15/01/21		17,25		53.911,00		09/12/20				54.852,18	17,250000	54.494,54	5,40	1,08	1,09
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL			15/01/21		17,50		20.966,92		09/12/20				21.338,26	17,500000	21.197,14	2,10	0,42	0,43
AKBANK T.A.Ş.	TL			02/02/21		18,25		255.931,95		28/12/20				260.537,68	18,250000	256.449,75	25,40	5,09	5,15
GARANTİ BANKASI A.Ş.	TL			02/02/21		18,25		210.326,71		30/12/20				213.901,98	18,250000	210.544,14	20,86	4,17	4,23
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL			04/02/21		19,00		164.672,87		29/12/20				167.844,04	19,000000	164.935,14	16,34	3,27	3,31
TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	TL			04/02/21		19,00		215.578,52		29/12/20				219.730,00	19,000000	215.921,87	21,39	4,28	4,34
GRUP TOPLAMI								1.006.052,75								1.009.407,79	100,00	20,01	20,27
GRUP TOPLAMI								1.006.052,75								1.009.407,79	100,00	20,01	20,27
TPP																			
TPP				04/01/21		17,75		350.680,82	17,750000	31/12/20			220840	350.680,82	17,750000	350.170,08	100,00	6,95	7,03
GRUP TOPLAMI								350.680,82								350.170,08	100,00	6,95	7,03
GRUP TOPLAMI								350.680,82								350.170,08	100,00	6,95	7,03
DIĞER																			
Y.Fonu Türk																			
İFG-İŞ PORTFÖY KAPİTAL SERBEST FON	TL		İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.					49.813,00	1,204494	23/05/19					1,459457	72.699,93	100,00	1,44	1,46
GRUP TOPLAMI								49.813,00								72.699,93	100,00	1,44	1,46
GRUP TOPLAMI								49.813,00								72.699,93	100,00	1,44	1,46
VIOP Nakit Teminatı																			
VIOP Nakit Teminatı																			
GRUP TOPLAMI								252.214,31								252.214,31	100,00	5,07	5,07
GRUP TOPLAMI								252.214,31								252.214,31	100,00	5,07	5,07

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu (Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRACCI 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)
GRUP TOPLAMI							252.214,31								252.214,31	100,00	5,07	
KİRA SERTİFİKALARI																		
Kamu Kesinli Kira Sertifikaları																		
TRD260122T19	TL	HAZINE	26/01/22		14,64		80.000,00	100,000000	29/01/20	13,716834				100,791485	80.833,19	2,55	1,60	1,62
GRUP TOPLAMI							80.000,00								80.833,19	2,55	1,60	1,62
GRUP TOPLAMI							80.000,00								80.833,19	2,55	1,60	1,62
FON PORTFÖY DEĞERİ															5.043.353,58		100,07	

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken 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	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%	TL	%	%
A.FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	5.043.354	100,00	98,59	3.479.337	100,00	95,96
B. HAZIR DEĞERLER (+)	2.108	100,00	0,04	1.798	100,00	0,05
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	2.108	100,00	0,04	1.798	100,00	0,05
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR (+)	2.240	100,00	0,04	171.955	100,00	4,74
a) Takastan Alacaklar	-	0,00	-	165.413	96	4,56
b) Diğer Alacaklar	2.240	100,00	0,04	6.542	3,80	0,18
D. BORÇLAR (-)	68.263	100,00	1,31	27.333	100,00	0,75
a) Takasa Borçlar	53.007	77,65	1,06	12.138	44,41	0,33
b) Yönetim Ücreti	3.634	5,32	0,07	2.507	9,17	0,07
e) Diğer Borçlar	8.789	12,88	0,18	12.687	46,42	0,35
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	4.979.438		100	3.625.756		100