

**Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Para
Piyasası 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. Para Piyasası 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. Para Piyasası 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. Para Piyasası 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

Anadolul Hayat Emeklilik A.Ş.Para Piyasası 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 SOZLEŞİM E NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvilii																		
TRT060121T16	TL	HAZINE	06/01/21		0,00		1.000.000,00	267,834400	03/12/20	0,000000		736190113 595609945		271,633721	2.716.337,21	0,32	0,19	0,19
TRT170221T12	TL	HAZINE	17/02/21		0,00		317.000.000,00	101,245400	23/12/20	15,070877		735516387 846060677		103,462793	327.977.053,55	39,14	22,90	23,17
TRT140421T13	TL	HAZINE	14/04/21		0,00		7.000.000,00	94,979300	08/12/20	15,598361		736388025 689200844		95,992114	6.719.447,95	0,80	0,47	0,47
TRT210421T14	TL	HAZINE	21/04/21		0,00		30.000.000,00	104,991400	16/12/20	15,490503		736704410 159867643		105,758713	31.727.613,97	3,79	2,22	2,24
GRUP TOPLAMI							355.000.000,00							369.140.452,68		44,05	25,78	26,07
Özel Sektör Finansman Bonosu																		
TRFORFN12115	TL	ORFİN FİNANSMAN GARANTİ FAKTORİNG A.Ş.	04/01/21		9,25		6.400.000,00	95,661000	09/07/20	9,467084				99,925682	6.395.243,65	0,76	0,45	0,45
TRFGRFA12126	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.	05/01/21		13,60		15.000.000,00	96,547000	01/10/20	14,285533				99,853773	14.978.065,95	1,79	1,05	1,06
TRFTHAL12136	TL	İŞ FAKTORİNG A.Ş.	07/01/21		0,50		25.000.000,00	100,000000	27/10/20	21,749878				102,852030	25.713.007,57	3,07	1,80	1,82
TRFISFA12112	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	08/01/21		13,50		20.000.000,00	96,399000	29/09/20	14,173804				99,746114	19.949.222,82	2,38	1,39	1,41
TRFYKKB12155	TL	İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	08/01/21		13,20		10.000.000,00	100,000000	20/10/20	21,022034				101,462944	10.146.294,42	1,21	0,71	0,72
TRFISFN12115	TL	GARANTİ FAKTORİNG A.Ş.	13/01/21		12,95		2.000.000,00	96,244000	25/09/20	13,545311				99,583232	1.991.664,64	0,24	0,14	0,14
TRFGRFA12134	TL	HALK LEASİNG FİNANSAL KİRALAMA	14/01/21		14,30		5.200.000,00	96,594000	16/10/20	15,089446				99,500699	5.174.036,36	0,62	0,36	0,37
TRFHFLK12118	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/21		13,60		9.000.000,00	96,200000	01/10/20	14,264383				99,469847	8.954.086,19	1,07	0,63	0,63
TRFYKKB12122	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	15/01/21		0,00		15.000.000,00	95,707000	22/07/20	15,973778		730885519 747919601		99,433197	14.914.979,60	1,78	1,04	1,05
TRFISGY12110	TL	GARANTİ FİNANSAL KİRALAMA	20/01/21		14,10		3.940.000,00	96,604000	21/10/20	14,864136				99,281221	3.911.680,12	0,47	0,27	0,28
TRFGRFK12117	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	21/01/21		12,90		4.000.000,00	95,931000	23/09/20	13,468364				99,310041	3.972.401,65	0,47	0,28	0,28
TRPVKFB12169	TL		21/01/21		1,00		20.000.000,00	100,000000	20/10/20	20,552711				100,514043	20.102.808,59	2,40	1,40	1,42

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş.Para Piyasası Emeklilik Yatırım

31 Aralık 2019 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 SOZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
TRFDZBK22131	TL	DENİZBANK A.Ş.	16/02/21		0,00		23.827.250,00	95,091000	29/12/20	11,461924		737178849 428176018		98,641749	23.503.616,20	2,81	1,64	1,66
TRFDZBK22149	TL	DENİZBANK A.Ş.	16/02/21		0,00		96.932.658,00	96,293200	31/12/20	11,807426		737258564 021400537		98,603282	95.578.782,07	11,41	6,68	6,75
TRFGRAN22137	TL	GARANTİ BANKASI A.Ş.	23/02/21		2,00		15.000.000,00	100,000000	04/12/20	21,041260				100,013904	15.002.085,62	1,79	1,05	1,06
TRFTHAL22143	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.	26/02/21		16,50		30.000.000,00	96,049000	27/11/20	17,693191				97,531522	29.259.456,50	3,49	2,04	2,07
TRFDZFK32115	TL	DENİZ FAKTORİNG A.Ş.	03/03/21		0,15		10.000.000,00	100,000000	09/12/20	19,515018				101,054825	10.105.482,54	1,21	0,71	0,71
TRPVFAS32113	TL	VAKİF FAKTORİNG A.Ş.	04/03/21		17,30		15.000.000,00	95,909000	04/12/20	18,459627				97,163492	14.574.523,86	1,74	1,02	1,03
TRFTFBK32115	TL	TÜRK EKONOMİ BANKASI A.Ş.	05/03/21		0,00		500.000,00	98,979800	28/12/20	19,825897		737060651 928045923		99,204137	496.020,68	0,06	0,03	0,04
TRFYKYM32110	TL	YAPI KREDİ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	10/03/21		17,30		8.000.000,00	95,865000	09/12/20	18,457137				96,893678	7.751.494,24	0,93	0,54	0,55
TRFTFBK32131	TL	TÜRK EKONOMİ BANKASI A.Ş.	19/03/21		0,00		5.000.000,00	98,083300	22/12/20	19,250317		736901772 498569364		98,618417	4.930.920,84	0,59	0,34	0,35
TRFFNBK42122	TL	QNB FİNANSBANK A.Ş.	09/04/21		2,00		10.000.000,00	100,000000	04/12/20	21,159620				101,395728	10.139.572,77	1,21	0,71	0,72
TRFVKFB42168	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	09/04/21		2,00		20.000.000,00	100,000000	04/12/20	19,215641				101,277303	20.255.460,56	2,42	1,42	1,43
TRFYKBK42111	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	09/04/21		0,20		15.000.000,00	100,000000	08/12/20	19,356535				101,099496	15.164.924,40	1,81	1,06	1,07
TRFFNBK42130	TL	QNB FİNANSBANK A.Ş.	16/04/21		0,60		40.000.000,00	100,000000	18/12/20	18,449774				100,610132	40.244.052,67	4,80	2,81	2,84
TRFAKYM42127	TL	AK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	20/04/21		2,00		12.500.000,00	100,000000	30/11/20	20,339937				100,124584	12.515.572,98	1,49	0,87	0,88
TRFALNF42114	TL	ALTERNATİFBANK A.Ş.	30/04/21		0,05		7.500.000,00	100,000000	31/12/20	20,766087				100,051706	7.503.877,95	0,90	0,52	0,53
TRFDZBK62111	TL	DENİZBANK A.Ş.	10/06/21		0,00		6.000.000,00	91,869500	15/12/20	20,016963		736624695 568147077		92,313136	5.538.788,14	0,66	0,39	0,39
TRFTHAL62115	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.	10/06/21		0,00		5.000.000,00	91,870100	22/12/20	9,505936		736901772 498569376		96,097576	4.804.878,78	0,57	0,34	0,34
GRUP TOPLAMI							455.799.908,00							453.573.002,37		54,15	31,69	32,05
GRUP TOPLAMI İleri Valörlü Alışlar Türk Özel Sektör							455.799.908,00							453.573.002,37		54,15	31,69	32,05

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş.Para Piyasası Emeklilik Yatırım

31 Aralık 2019 Tarihli Fiyat Raporu

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

MENKUL KİYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRACÇI 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 E NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
TRTFEBK32123	TL	TÜRK EKONOMİ BANKASI A.Ş.	12/03/21	0,00			15.000.000,00	98,979780	04/01/21			737298421		100,614480	15.092.172,00	1,80	1,05	1,07
GRUP												317146435						
TOPLAMI							15.000.000,00							15.092.172,00		1,80	1,05	1,07
GRUP							825.799.908,00							837.805.627,05		100,00	58,52	59,19
T.REPO																		
TRT020823T11	TL	HAZİNE	04/01/21	17,98			17.033.496,99	17,980000	31/12/20		7.643.210,00	737298421	17.033.496,99	17,980000	17.008.368,07	9,36	1,19	1,20
TRT020823T11	TL	HAZİNE	04/01/21	17,90			11.021.578,08	17,900000	31/12/20		4.945.570,00	737298421	11.021.578,08	17,900000	11.005.390,55	6,06	0,77	0,78
TRT020823T11	TL	HAZİNE	04/01/21	17,90			39.076.504,11	17,900000	31/12/20		17.534.270,00	737298421	39.076.504,11	17,900000	39.019.111,97	21,48	2,73	2,76
TRT020823T11	TL	HAZİNE	04/01/21	17,90			31.060.810,96	17,900000	31/12/20		13.937.495,00	737298421	31.060.810,96	17,900000	31.015.191,57	17,07	2,17	2,19
TRT060825T15	TL	HAZİNE	04/01/21	17,90			50.098.082,19	17,900000	31/12/20		50.631.745,00	737298421	50.098.082,19	17,900000	50.024.502,53	27,54	3,49	3,53
TRT110226T13	TL	HAZİNE	04/01/21	17,98			33.065.023,56	17,980000	31/12/20		35.306.270,00	737298421	33.065.023,56	17,980000	33.016.243,89	18,17	2,31	2,33
TRT160425T33	TL	HAZİNE	04/01/21	11,06			230.278,77	11,060000	31/12/20		232.005,00	737298421	230.278,77	11,060000	230.069,66	0,13	0,02	0,02
TRT160425T33	TL	HAZİNE	04/01/21	11,06			340.412,10	11,060000	31/12/20		342.965,00	737298421	340.412,10	11,060000	340.102,98	0,19	0,02	0,02
GRUP														181.658.981,22		100,00	12,70	12,83
TOPLAMI							181.926.186,76							181.658.981,22		100,00	12,70	12,83
MEVDUAT																		
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL		05/01/21	16,75			10.000.000,00		30/11/20				10.164.816,79	16,750000	10.146.377,43	3,51	0,71	0,72
TÜRK EKONOMİ BANKASI A.Ş.	TL		12/01/21	16,85			60.000.000,00		03/12/20				61.105.826,18	16,850000	60.799.956,50	21,02	4,25	4,30
FİBA BANKA A.Ş.	TL		12/01/21	17,00			10.000.000,00		03/12/20				10.185.945,05	17,000000	10.134.509,96	3,50	0,71	0,72
AKBANK T.A.Ş.	TL		15/01/21	17,15			5.000.000,00		09/12/20				5.086.783,45	17,150000	5.053.806,92	1,75	0,35	0,36
AKBANK T.A.Ş.	TL		15/01/21	17,00			20.000.000,00		09/12/20				20.344.097,61	17,000000	20.213.351,25	6,99	1,41	1,43
TİŞ BANKASI A.Ş.	TL		02/02/21	18,25			30.427.397,26		28/12/20				30.974.965,70	18,250000	30.488.957,20	10,54	2,13	2,15
TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	TL		04/02/21	18,25			20.454.109,59		29/12/20				20.832.464,73	18,250000	20.485.412,28	7,08	1,43	1,45
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL		04/02/21	19,00			70.865.573,77		29/12/20				72.230.262,56	19,000000	70.978.442,50	24,52	4,96	5,01
TOPLAMI							60.914.754,10		29/12/20				62.087.815,68	19,000000	61.011.774,00	21,09	4,26	4,31
GRUP							287.661.834,72							289.312.588,04		100,00	20,21	20,45
TOPLAMI							287.661.834,72							289.312.588,04		100,00	20,21	20,45
TPP																		

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım

31 Aralık 2019 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 FIYATI	SATIN ALISH TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞİM E NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
TPP			05/01/21	16,50			10.207.945,21	16,500000	20/11/20			190282	10.207.945,21	16,500000	10.189.692,64	9,06	0,71	0,72
TPP			07/01/21	16,25			9.750.330,00	16,250000	24/11/20			192590	9.750.330,00	16,250000	9.724.570,50	8,65	0,68	0,69
TPP			07/01/21	16,25			5.543.505,62	16,250000	24/11/20			192591	5.543.505,62	16,250000	5.528.860,18	4,92	0,39	0,39
TPP			08/01/21	9,00			5.224.383,56	9,000000	10/07/20			106456	5.224.383,56	9,100000	5.215.470,07	4,64	0,36	0,37
TPP			08/01/21	9,00			26.121.917,81	9,000000	10/07/20			106457	26.121.917,81	9,100000	26.077.350,35	23,17	1,82	1,84
TPP			11/01/21	16,30			4.580.156,84	16,300000	25/11/20			193537	4.580.156,84	16,300000	4.559.959,35	4,05	0,32	0,32
TPP			11/01/21	16,30			3.726.610,00	16,300000	25/11/20			193538	3.726.610,00	16,300000	3.710.176,46	3,30	0,26	0,26
TPP			11/01/21	16,30			1.020.989,04	16,300000	25/11/20			193562	1.020.989,04	16,300000	1.016.486,70	0,90	0,07	0,07
TPP			18/01/21	9,25			15.688.047,95	9,250000	21/07/20			111496	15.688.047,95	9,250000	15.622.095,64	13,89	1,09	1,10
TPP			18/01/21	16,80			10.276.164,38	16,800000	19/11/20			189136	10.276.164,38	16,800000	10.197.152,49	9,07	0,71	0,72
TPP			22/01/21	9,50			5.231.643,84	9,500000	28/07/20			115588	5.231.643,84	9,500000	5.203.766,12	4,63	0,36	0,37
TPP			16/02/21	17,00			5.209.589,04	17,000000	18/11/20			188045	5.209.589,04	17,000000	5.101.390,69	4,54	0,36	0,36
TPP			14/04/21	15,55			2.476.375,34	15,550000	16/10/20			165639	2.476.375,34	15,550000	2.373.857,47	2,11	0,17	0,17
TPP			14/04/21	15,55			5.383.424,66	15,550000	16/10/20			165657	5.383.424,66	15,550000	5.160.559,74	4,59	0,36	0,36
TPP			14/04/21	15,55			2.907.049,32	15,550000	16/10/20			165720	2.907.049,32	15,550000	2.786.702,26	2,48	0,20	0,20
GRUP							113.348.132,61							112.468.090,66		100,00	7,86	7,94
TOPLAMI							113.348.132,61							112.468.090,66		100,00	7,86	7,94
GRUP																		
TOPLAMI																		
KATILIM																		
HESABI																		
KATILIM																		
HESABI																		
TURKIYE																		
FINANS																		
KATILIM	TL		05/01/21	16,75			10.000.000,00		30/11/20				10.164.754,10	16,750000	10.146.448,09	100,00	0,71	0,72
BANKASI A.Ş.																		
GRUP																		
TOPLAMI																		
GRUP																		
TOPLAMI																		
FON PORTFÖY																		
DEĞERİ																		
														1.431.391.735,06		100,00	100,00	

(5)

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Para Piyasası 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	1.431.391.735	100,00	101,09	1.443.654.007	100,00	100,00
B. HAZIR DEĞERLER (+)	18.684	100,00	-	14.113	100,00	-
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	18.684	100,00	-	14.113	100,00	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR (+)	243.161	100,00	0,02	1.226.000	100	0,08
a) Takaslan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	243.161	100,00	0,02	1.226.000	100	0,08
D. BORÇLAR (-)	16.131.206	100,00	1,11	1.192.302	100,00	0,08
a) Takasa Borçlar	(14.846.967)	(92)	-	-	-	-
b) Yönetim Ücreti	(1.199.285)	(7,43)	-	1.189.785	99,79	0,08
c) Diğer Borçlar	(42.487)	(0,26)	-	2.517	0,21	-
d)Kayda Alma Ücreti	(42.467)	(0,26)	-	-	-	-
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	1.415.522.374		100,00	1.443.701.818		100,00