

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

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



EY

**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. Birinci 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. Birinci 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. Birinci 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. Birinci 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)
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Eurobond Türk																		
XS1345632811	USD	EXIMBANK	08/02/21	38	0,03	2	200.000,00	99,659900	10/08/20	0,000000				102,558139	1.521.839,71	0,07	0,06	0,06
US900123BH29	USD	HAZİNE	30/03/21	88	1,56	2	50.000,00	103,512500	23/11/20	0,000000				102,308750	379.534,77	0,02	0,02	0,02
XS1571399754	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	24/02/22	419	2,00	2	3.700.000,00	103,390600	29/12/20	0,000000				103,652500	28.454.456,26	1,22	1,11	1,14
US900123BY51	USD	HAZİNE	25/03/22	448	2,15	2	2.550.000,00	103,861100	30/12/20	0,000000				104,051931	19.686.073,79	0,85	0,77	0,79
XS1508390090	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	21/04/22	475	0,92	2	4.650.000,00	99,899400	21/12/20	0,000000				102,547167	35.378.987,85	1,52	1,38	1,41
XS1605397394	USD	TC ZİRAAT BANKASI	03/05/22	487	0,80	2	1.150.000,00	101,290900	29/12/20	0,000000				101,634458	8.671.767,05	0,37	0,34	0,35
XS1622626379	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/05/22	514	0,33	2	1.200.000,00	101,110500	21/12/20	0,000000				101,700250	9.054.658,02	0,39	0,35	0,36
XS1684378208	USD	EXIMBANK	18/09/22	625	1,11	2	650.000,00	100,432100	22/12/20	0,000000				100,743167	4.858.450,03	0,21	0,19	0,19
US900123BZ27	USD	HAZİNE	26/09/22	633	3,11	2	13.500.000,00	104,731500	21/12/20	0,000000				106,483444	106.655.841,14	4,59	4,17	4,26
USM0375YAK49	USD	AKBANK T.A.Ş.	24/10/22	661	0,92	2	950.000,00	101,797500	31/12/20	0,000000				102,281667	7.209.251,68	0,31	0,28	0,29
XS0847042024	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	24/10/22	661	1,10	2	1.200.000,00	101,054200	30/12/20	0,000000				102,333500	9.111.038,04	0,39	0,36	0,36
XS0861979440	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	06/12/22	704	0,35	2	400.000,00	100,581400	29/12/20	0,000000				100,859667	2.993.272,84	0,13	0,12	0,12
XS1750996206	USD	T.SİNAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	16/01/23	745	2,37	2	1.100.000,00	96,255500	21/12/20	0,000000				102,937556	8.401.083,90	0,36	0,33	0,34
XS1760780731	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/01/23	759	2,25	2	3.000.000,00	103,015800	21/12/20	0,000000				103,515333	23.040.649,92	0,99	0,90	0,92
XS1788516679	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	16/03/23	804	1,54	2	4.325.000,00	99,570900	17/12/20	0,000000				103,889722	33.337.074,27	1,43	1,30	1,33
US900123CA66	USD	HAZİNE	23/03/23	811	0,23	2	7.520.000,00	93,130600	04/06/20	0,000000				100,768694	56.222.772,51	2,42	2,20	2,25
US900123CR91	USD	HAZİNE	25/12/23	1.088	1,85	2	5.000.000,00	103,791200	25/09/20	0,000000				109,541972	40.636.785,43	1,75	1,59	1,62
US900123CF53	USD	HAZİNE	22/03/24	1.176	0,06	2	13.485.000,00	103,544100	26/09/19	0,000000				106,981778	107.035.920,19	4,60	4,18	4,28
XS1970705528	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	28/03/24	1.182	0,56	2	1.500.000,00	100,192200	23/10/20	0,000000				109,369889	12.171.884,30	0,52	0,48	0,49

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Birinci 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 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)
XS1578203462	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	25/04/24	1.210	1,07	2	1.950.000,00	95,919800	28/06/19	0,000000				103,260403	14.939.539,53	0,64	0,58	0,60
XS1814962582	USD	EXIMBANK	03/05/24	1.218	0,97	2	1.500.000,00	101,123800	30/12/20	0,000000				103,443792	11.512.363,02	0,50	0,45	0,46
US900123CV04	USD	HAZİNE	12/08/24	1.319	0,02	2	1.000.000,00	99,017600	29/08/19	0,000000				109,977944	8.159.703,61	0,35	0,32	0,33
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24	1.413	0,25	2	7.500.000,00	101,968100	30/11/20	0,000000				105,742556	58.840.973,75	2,53	2,30	2,35
US900123AW05	USD	HAZİNE	05/02/25	1.496	1,17	2	12.050.000,00	111,626600	01/12/20	0,000000				114,774486	102.612.717,58	4,41	4,01	4,10
US900123CZ18	USD	HAZİNE	14/10/25	1.747	0,71	2	9.800.000,00	99,724600	22/12/20	0,000000				109,625833	79.709.074,97	3,43	3,11	3,19
US900123CJ75	USD	HAZİNE	14/04/26	1.929	1,74	2	10.500.000,00	93,352500	11/03/19	0,000000				100,209722	78.067.081,37	3,36	3,05	3,12
US900123CK49	USD	HAZİNE	09/10/26	2.107	0,68	2	12.560.000,00	97,344200	29/11/19	0,000000				102,485875	95.504.192,84	4,11	3,73	3,82
US900123CL22	USD	HAZİNE	25/03/27	2.274	0,52	2	12.502.000,00	102,362800	26/10/20	0,000000				107,960833	100.141.595,94	4,31	3,91	4,00
US900123CP36	USD	HAZİNE	17/02/28	2.603	1,58	2	15.250.000,00	93,228900	08/12/20	0,000000				103,390403	116.981.950,04	5,03	4,57	4,68
US900123CQ19	USD	HAZİNE	24/10/28	2.853	2,94	2	9.800.000,00	95,557500	17/10/19	0,000000				107,968917	78.504.328,87	3,38	3,07	3,14
US900123CT57	USD	HAZİNE	26/04/29	3.037	1,19	2	11.400.000,00	105,857900	22/12/20	0,000000				117,100556	99.045.008,26	4,26	3,87	3,96
US900123AL40	USD	HAZİNE	15/01/30	3.301	0,73	2	935.000,00	157,921100	21/02/20	0,000000				151,522708	10.511.340,89	0,45	0,41	0,42
XS2106022754	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	22/01/30	3.308	0,00	2	400.000,00	100,050000	22/01/20	0,000000				102,783889	3.050.379,14	0,13	0,12	0,12
US900123CY43	USD	HAZİNE	13/03/30	3.358	1,24	2	9.650.000,00	98,457200	08/12/20	0,000000				102,171417	73.151.883,75	3,15	2,86	2,92
US900123DA57	USD	HAZİNE	15/01/31	3.666	0,25	2	3.700.000,00	100,391200	22/12/20	0,000000				104,937278	28.807.150,63	1,24	1,12	1,15
US900123AT75	USD	HAZİNE	14/02/34	4.792	2,62	2	13.924.000,00	118,174000	21/09/20	0,000000				122,805222	126.867.281,99	5,46	4,96	5,07
US900123AY60	USD	HAZİNE	17/03/36	5.554	0,11	2	21.600.000,00	105,241500	05/11/20	0,000000				111,173014	178.164.804,80	7,64	6,94	7,12
US900123BB58	USD	HAZİNE	05/03/38	6.272	6,58	2	9.200.000,00	110,764400	17/04/18	0,000000				115,134972	78.589.381,99	3,38	3,07	3,14
US900123BG46	USD	HAZİNE	30/05/40	7.089	0,86	2	11.360.000,00	112,849200	14/12/20	0,000000				107,495000	90.601.498,58	3,90	3,54	3,62
US900123BJ84	USD	HAZİNE	14/01/41	7.318	10,00	2	6.000.000,00	101,820300	03/10/17	0,000000				101,736667	45.289.501,48	1,95	1,77	1,81
US900123CB40	USD	HAZİNE	16/04/43	8.140	0,79	2	2.550.000,00	82,172300	14/12/20	0,000000				88,970083	16.832.668,22	0,72	0,66	0,67
US900123CG37	USD	HAZİNE	17/02/45	8.813	2,58	2	16.650.000,00	104,839900	07/07/20	0,000000				107,469569	132.760.393,96	5,71	5,18	5,31
US900123CM05	USD	HAZİNE	11/05/47	9.626	2,67	2	18.850.000,00	83,324000	22/12/20	0,000000				96,359639	134.764.437,85	5,80	5,26	5,39
GRUP TOPLAMI							286.761.000,00							2.278.230.594,76		97,98	88,99	91,07
İleri Valörlü Alışlar Yabancı Eurobond Türk																		
XS1788516679	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	16/03/23	800	1,85	2	3.100.000,00	105,146945	05/01/21					103,974444	23.914.267,69	1,03	0,93	0,96

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Birinci 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 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)
XS1788516679	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	16/03/23	801	1,83	2	1.000.000,00	105,130000	04/01/21					103,957500	7.713.022,80	0,33	0,30	0,31
XS1970705528	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	28/03/24	1.177	2,21	2	1.500.000,00	110,211805	06/01/21					109,505303	12.186.954,60	0,52	0,48	0,49
XS1578203462	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	25/04/24	1.205	1,21	2	1.000.000,00	104,107986	06/01/21					103,362486	7.668.876,30	0,33	0,30	0,31
XS1578203462	USD	T.İŞ BANKASI A.Ş.	25/04/24	1.206	1,19	2	900.000,00	104,090972	05/01/21					103,345472	6.900.852,51	0,30	0,27	0,28
XS1814962582	USD	EXIMBANK	03/05/24	1.213	1,07	2	1.500.000,00	104,221875	06/01/21					103,545876	11.523.724,05	0,50	0,45	0,46
GRUP TOPLAMI							9.000.000,00							69.907.697,95		3,01	2,73	2,81
İleri Valörlü Satışlar Yabancı Eurobond Türk																		
XS1760780731	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/01/23	756	2,46	2	-3.000.000,00	104,359722	04/01/21					103,579221	-23.054.870,10	-0,99	-0,90	-0,92
GRUP TOPLAMI							-3.000.000,00							-23.054.870,10		-0,99	-0,90	-0,92
GRUP TOPLAMI							292.761.000,00							2.325.083.422,61		100,00	90,82	92,96
T.REPO																		
TRT020823T11	TL	HAZİNE	04/01/21	3	17,95	2	15.029.506,85	17,950000	31/12/20		6.743.985,00	737298421317126349	15.029.506,85	17,950000	15.007.371,28	38,11	0,59	0,60
TRT140623T19	TL	HAZİNE	04/01/21	3	17,95	2	24.047.210,96	17,950000	31/12/20		23.471.690,00	737298421317126348	24.047.210,96	17,950000	24.011.794,04	60,98	0,94	0,96
TRT160425T33	TL	HAZİNE	04/01/21	3	11,06	4	360.436,34	11,060000	31/12/20		363.135,00	737298421317117475	360.436,34	11,060000	360.109,04	0,91	0,01	0,01
GRUP TOPLAMI							39.437.154,15							39.379.274,36		100,00	1,54	1,57
GRUP TOPLAMI							39.437.154,15							39.379.274,36		100,00	1,54	1,57
MEVDUAT																		
T. HALK BANKASI A.Ş.	USD		15/01/21	14	3,70		5.000.000,00		18/12/20				5.014.173,78	3,700000	37.149.620,22	100,00	1,45	1,48
GRUP TOPLAMI							5.000.000,00							37.149.620,22		100,00	1,45	1,48
GRUP TOPLAMI							5.000.000,00							37.149.620,22		100,00	1,45	1,48
DİĞER																		
Y.Fonu Türk																		
IAG-İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					28.365.415,00	1,298694	16/12/20					1,676544	47.555.866,33	31,28	1,86	1,90

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Birinci 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 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)
IIK-IŞ PORT.YÖN.A.Ş. QUASAR İST.KONUT KATILIM GYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					13.450.000,00	1,000000	03/04/19					1,145757	15.410.431,65	10,14	0,60	0,62
IPG-IŞ PORTFÖY KAPİTAL SERBEST FON	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					6.738.239,00	1,402925	17/09/20					1,459457	9.834.170,08	6,47	0,38	0,39
ISZ-IŞ PORTFÖY BİRİNCİ GYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					53.076.411,00	1,146460	01/12/20					1,419664	75.350.669,95	49,55	2,94	3,01
IYG-IŞ PORTFÖY YENİLENEBİLİR ENERJİ GSYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ					3.700.000,00	1,000000	13/01/20					1,053363	3.897.443,10	2,56	0,15	0,16
GRUP TOPLAMI							105.330.065,00							152.048.581,11		100,00	5,93	6,08
GRUP TOPLAMI							105.330.065,00							152.048.581,11		100,00	5,93	6,08
TÜREV																		
Futures																		
Kısa																		
F_USDTRY0221	TL						7.000,00	7,509300	29/12/20			80176126726233680		7,583700	53.085.900,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							7.000,00							53.085.900,00		0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							7.000,00							53.085.900,00		0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatl																		
VIOP Nakit Teminatl															6.696.921,34	100,00	0,27	
GRUP TOPLAMI							6.696.921,34							6.696.921,34		100,00	0,27	
GRUP TOPLAMI							6.696.921,34							6.696.921,34		100,00	0,27	
DİĞER																		
Döviz																		
EUR	EUR	EU					5.505,93	2,360865	31/12/20					9,116400	50.194,26	0,00	0,00	0,00
USD	USD	FED					514.731,31	7,540943	31/12/20					7,419400	3.818.997,48	0,00	0,00	0,15
GRUP TOPLAMI							520.237,24							3.869.191,74		0,00	0,00	0,15
GRUP TOPLAMI							520.237,24							3.869.191,74		0,00	0,00	0,15
FON PORTFÖY DEĞERİ														2.560.357.819,64			100,01	

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Birinci 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	2.420.542.424	100,00	96,69	1.860.824.948	100,00	100,22
B. HAZIR DEĞERLER (+)	3.871.931	100,00	0,15	4.248.573	100,00	0,23
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	2.739	0,07	-	5.749	0,14	-
c) Diğer Hazır Değerler	3.869.192	99,93	0,15	4.242.824	99,86	0,23
C.ALACAKLAR (+)	94.091.702	100,00	3,76	149.562	100,00	0,01
a) Takastan Alacaklar	93.751.915	99,64	3,74	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	339.787	0,36	0,01	149.562	100,00	0,01
D. BORÇLAR (-)	14.977.545	100,00	0,60	8.552.797	100,00	0,46
a) Takasa Borçlar	10.864.219	72,54	0,43	5.808.424	67,91	0,31
b) Yönetim Ücreti	4.035.536	26,94	0,16	2.742.163	32,06	0,15
c) Diğer Borçlar	2.684	0,02	-	2.210	0,03	-
d) Kayda Alma Ücreti	75.106	0,50	-	-	-	-
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	2.503.528.512		100	1.856.670.286		100