

**Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci
Borçlanma Araçları Grup 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 Borçlanma Araçları Grup 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 Borçlanma Araçları Grup 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 Borçlanma Araçları Grup 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 Borçlanma Araçları Grup 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)
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvil																		
TRT170221T12	TL	HAZİNE	17/02/21		0,00		2.150.000,00	104,569400	31/12/20	15,070877		731796740009814421		103,462793	2.224.450,05	1,59	1,27	1,27
TRT090621T18	TL	HAZİNE	09/06/21		0,00		5.000.000,00	92,053800	30/12/20	16,070767		730410530724643530		93,714256	4.685.712,79	3,35	2,67	2,68
TRT220921T18	TL	HAZİNE	22/09/21		0,00		2.000.000,00	102,299700	30/10/20	16,437280		730292333225983162		98,142914	1.962.858,27	1,40	1,12	1,12
TRT201021T25	TL	HAZİNE	20/10/21		0,00		1.000.000,00	107,030800	06/05/20	16,292377		727837398637715656		101,333891	1.013.338,91	0,73	0,58	0,58
TRT120122T17	TL	HAZİNE	12/01/22		0,00		17.036.925,00	102,570900	06/08/20	15,940428		730569135276777072		99,064143	16.877.483,68	12,08	9,60	9,64
TRT260122T11	TL	HAZİNE	26/01/22		9,84		986.039,00	100,280000	21/05/20	16,320422				102,999645	1.015.616,67	0,73	0,58	0,58
TRT020322T17	TL	HAZİNE	02/03/22		0,00		9.200.000,00	101,680800	09/10/20	15,690596		733141717608674372		99,391680	9.144.034,57	6,54	5,20	5,23
TRT040522T13	TL	HAZİNE	04/05/22		0,00		2.000.000,00	97,613500	16/09/20	15,357358		733062552771508420		94,609028	1.892.180,56	1,35	1,08	1,08
TRT170822T15	TL	HAZİNE	17/08/22		0,00		10.500.000,00	101,332100	12/10/20	15,158939		730331915644326562		98,476065	10.339.986,81	7,40	5,89	5,91
TRT140922T17	TL	HAZİNE	14/09/22		0,00		165.527,00	98,481800	11/05/20	14,825830		727362409615386490		93,985595	155.571,54	0,11	0,09	0,09
TRT180123T10	TL	HAZİNE	18/01/23		0,00		3.734.000,00	104,175000	01/10/20	14,422297		732547981329641707		102,500834	3.827.381,14	2,74	2,18	2,19
TRT080323T10	TL	HAZİNE	08/03/23		0,00		10.571.394,00	86,750600	18/08/20	14,373707		729302223003648328		89,820049	9.495.231,30	6,80	5,40	5,43
TRT140623T19	TL	HAZİNE	14/06/23		0,00		1.000.000,00	121,887900	01/06/20	14,443294		728748069143803107		105,306916	1.053.069,16	0,75	0,60	0,60
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23		0,00		8.582.623,00	95,128500	18/12/20	14,236678		729539717515708150		91,257275	7.832.267,85	5,61	4,46	4,48
TRT181023T19	TL	HAZİNE	18/10/23		0,00		2.900.000,00	123,070100	19/11/20	13,855745		735635684857909215		119,213375	3.457.187,88	2,47	1,97	1,98
TRT200324T13	TL	HAZİNE	20/03/24		0,00		2.000.000,00	103,877100	26/06/20	13,911101		729777212027481487		95,112925	1.902.258,50	1,36	1,08	1,09
TRT240724T15	TL	HAZİNE	24/07/24		0,00		4.915.106,00	91,409500	06/08/20	13,494452		729737904486932968		92,614111	4.552.081,72	3,26	2,59	2,60
TRT120325T12	TL	HAZİNE	12/03/25		0,00		500.000,00	68,325600	11/06/19	13,365786		712124552842543869		86,759820	433.799,10	0,31	0,25	0,25
TRT011025T16	TL	HAZİNE	01/10/25		0,00		2.000.000,00	102,507700	30/12/20	13,201613		737258564020465607		102,382782	2.047.655,65	1,47	1,17	1,17
TRT110226T13	TL	HAZİNE	11/02/26		0,00		3.600.000,00	90,781500	16/12/20	12,845105		734843486729881934		97,138146	3.496.973,24	2,50	1,99	2,00
TRT240227T17	TL	HAZİNE	24/02/27		0,00		4.100.000,00	94,894700	01/10/20	13,003484		733656563928566678		97,015497	3.977.635,36	2,85	2,26	2,27
TRT110827T16	TL	HAZİNE	11/08/27		0,00		14.200.000,00	94,195200	21/12/20	12,897311		736784399630493220		95,146619	13.510.819,91	9,67	7,69	7,72
TRT080328T15	TL	HAZİNE	08/03/28		0,00		6.000.000,00	102,381700	20/11/20	12,982871		735635684858658035		102,895407	6.173.724,41	4,42	3,51	3,53
TRT131130T14	TL	HAZİNE	13/11/30		0,00		1.500.000,00	96,996500	25/12/20	12,946128		737021069509347042		96,597219	1.448.958,29	1,04	0,82	0,83
GRUP TOPLAMI							115.641.614,00								112.520.277,36	80,53	64,05	64,32
Özel Sektör																		
Finansman Bonosu																		
TRFYKBK12114	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	22/01/21		9,25		4.000.000,00	94,856000	22/06/20	20,190969				98,947456	3.957.898,25	2,83	2,25	2,26
TRFYKBK22147	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	05/02/21		0,75		5.000.000,00	100,000000	13/11/20	19,835854				100,327071	5.016.353,53	3,59	2,85	2,87
TRFTHAL22143	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.	26/02/21		16,50		4.000.000,00	96,049000	27/11/20	17,693191				97,531522	3.901.260,87	2,79	2,22	2,23
GRUP TOPLAMI							13.000.000,00								12.875.512,65	9,21	7,32	7,36
Özel Sektör Tahvil																		
TRSTPRS12115	TL	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL	22/01/21		25,29		150.000,00	100,000000	18/09/19	20,789948				102,587083	153.880,62	0,11	0,09	0,09

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Borçlanma Araçları Grup Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2020 Tarihli Fiyat Raporu

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

TRSTPRS22114	TL	RAFİNERİLERİ A.Ş. TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	05/02/21	24,70	150.000,00	100,000000	08/10/19	18,654137		102,530593	153.795,89	0,11	0,09	0,09	
TRSENJRJ22110	TL	ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	23/02/21	0,00	2.050.000,00	113,034400	28/02/19	4,098145	71069876113 9399568	169,433343	3.473.383,52	2,49	1,98	1,98	
TRSMGTI22115	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	24/02/21	27,36	850.000,00	100,000000	27/02/19	19,534416		102,195860	868.664,81	0,62	0,49	0,50	
TRSMGTI72110	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	14/07/21	23,61	2.880.000,00	100,000000	19/07/18	18,974586		103,796529	2.989.340,05	2,14	1,70	1,71	
TRSENSA32314	TL	ENERJİSA ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	30/03/23	0,00	4.000.000,00	102,656100	20/09/18	3,551798	70432544198 8917827	153,761648	6.150.465,93	4,40	3,50	3,51	
GRUP TOPLAMI					10.080.000,00						13.789.530,82	9,87	7,85	7,88	
GRUP TOPLAMI					23.080.000,00						26.665.043,47	19,08	15,17	15,24	
GRUP TOPLAMI					138.721.614,00						139.185.320,83	99,61	79,22	79,56	
T.REPO															
TRT020823T11	TL	HAZİNE	04/01/21	17,95	10.019.671,2 3	17,950000	31/12/20	4.495.995,00	73729842131 7127232	10.019.671,23	17,950000	10.004.914,18	87,04	5,69	5,72
TRT160425T33	TL	HAZİNE	04/01/21	11,06	490.593,91	11,060000	31/12/20	494.270,00	73729842131 7117493	490.593,91	11,060000	490.148,41	4,26	0,28	0,28
TRT261022T10	TL	HAZİNE	04/01/21	17,95	1.001.967,12	17,950000	31/12/20	431.820,00	73729842131 7127233	1.001.967,12	17,950000	1.000.491,42	8,70	0,57	0,57
GRUP TOPLAMI					11.512.232,26						11.495.554,01	100,00	6,54	6,57	
GRUP TOPLAMI					11.512.232,26						11.495.554,01	100,00	6,54	6,57	
MEVDUAT															
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL		06/01/21	16,75	4.282.858,02		01/12/20			4.353.452,08	16,750000	4.343.582,66	43,82	2,47	2,48
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL		04/02/21	19,00	4.541.696,01		29/12/20			4.629.157,40	19,000000	4.548.929,64	45,89	2,59	2,60
FİBABANKA	TL		04/02/21	19,00	1.017.867,49		29/12/20			1.037.469,00	19,000000	1.019.488,66	10,29	0,58	0,58
GRUP TOPLAMI					9.842.421,52							9.912.000,96	100,00	5,64	5,66
GRUP TOPLAMI					9.842.421,52							9.912.000,96	100,00	5,64	5,66
DİĞER															
Y.Fonu Türk															
IAG-İŞ PORTFÖY ALTYAPI GSYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ			3.410.588,00	1,216898	16/12/20				1,676544	5.718.000,85	39,27	3,25	3,27
ISZ-İŞ PORTFÖY BİRİNCİ GYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ			5.181.653,00	1,000000	14/10/20				1,419664	7.356.206,22	50,51	4,19	4,20
IYG-İŞ PORTFÖY YENİLENEBİLİR ENERJİ GSYF	TL	İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ			1.412.241,00	1,026736	17/07/20				1,053363	1.487.602,42	10,22	0,85	0,85
GRUP TOPLAMI					10.004.482,00							14.561.809,49	100,00	8,29	8,32
GRUP TOPLAMI					10.004.482,00							14.561.809,49	100,00	8,29	8,32
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
TRD260122T19	TL	HAZİNE	26/01/22	14,64	540.000,00	100,000000	14/05/20	13,716834		100,791485	544.274,02	0,39	0,31	0,31	
GRUP TOPLAMI					540.000,00							544.274,02	0,39	0,31	0,31
GRUP TOPLAMI					540.000,00							544.274,02	0,39	0,31	0,31
FON PORTFÖY DEĞERİ												175.698.959,31		100,00	

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. İkinci Borçlanma Araçları Grup 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	175.698.959	100,00	100,41	215.095.072	100,00	100,37
B. HAZIR DEĞERLER (+)	9.906	100,00	0,01	2.851	100,00	-
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	9.906	100,00	0,01	2.851	100,00	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR (+)	-	-	-	1.603.945	100	0,75
a) Takastan Alacaklar	-	-	-	1.603.945	100	0,75
b) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
D. BORÇLAR (-)	718.884	100,00	0,42	2.410.240	100,00	1,12
a) Takasa Borçlar	559.861	77,88	0,33	2.232.262	92,62	1,04
b) Yönetim Ücreti	151.091	21,02	0,09	175.874	7,30	0,08
e) Diğer Borçlar	2.682	0,36	-	2.104	0,08	-
f) Kayda Alma Ücreti	5.250	0,72	-	-	0,08	-
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	174.989.981		100	214.291.628		100