

**Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. 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. 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. 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. 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. 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 Tahvili																		
TRT201021T25	TL	HAZİNE	20/10/21		0,00		700.000,00	106,264300	24/02/20	16,292377		722652376678584504		101,333891	709.337,23	1,04	0,97	0,97
TRT120122T17	TL	HAZİNE	12/01/22		0,00		1.000.000,00	99,873100	04/03/20	15,940428		725344256021380475		99,064143	990.641,43	1,46	1,35	1,35
TRT020322T17	TL	HAZİNE	02/03/22		0,00		2.000.000,00	104,526500	13/08/20	15,690596		731756607835059198		99,391680	1.987.833,60	2,93	2,71	2,71
TRT040522T13	TL	HAZİNE	04/05/22		0,00		500.000,00	98,584100	02/10/20	15,357358		733697520736841548		94,609028	473.045,14	0,70	0,65	0,64
TRT170822T15	TL	HAZİNE	17/08/22		0,00		2.500.000,00	102,399200	17/08/20	15,158939		731914387753336223		98,476065	2.461.901,62	3,62	3,35	3,36
TRT180123T10	TL	HAZİNE	18/01/23		0,00		3.000.000,00	102,063600	28/10/20	14,422297		734725564109016805		102,500834	3.075.025,02	4,53	4,19	4,19
TRT080323T10	TL	HAZİNE	08/03/23		0,00		2.000.000,00	89,549000	10/11/20	14,373707		735239310917042898		89,820049	1.796.400,99	2,64	2,45	2,45
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23		0,00		1.000.000,00	93,327200	21/12/20	14,236678		736784399631765236		91,257275	912.572,75	1,34	1,24	1,24
GRUP TOPLAMI							12.700.000,00							12.406.757,78		18,26	16,91	16,91
Eurobond Türk																		
XS0993155398	EUR	HAZİNE	12/11/21		6,36		200.000,00	96,725800	22/09/20	0,000000				103,598973	1.888.899,35	2,78	2,57	2,58
XS1605397394	USD	TC ZIRAAT BANKASI	03/05/22		0,71		200.000,00	99,461800	23/06/20	0,000000				101,634458	1.508.133,40	2,22	2,06	2,06
XS1622626379	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/05/22		1,56		400.000,00	99,915000	10/09/20	0,000000				101,700250	3.018.219,34	4,44	4,11	4,11
XS1684378208	USD	EXIMBANK	18/09/22		0,14		200.000,00	89,641700	30/03/20	0,000000				100,743167	1.494.907,70	2,20	2,04	2,04
XS1788516679	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	16/03/23		1,22		200.000,00	100,820000	28/05/20	0,000000				103,889722	1.541.598,81	2,27	2,10	2,10
XS1057340009	EUR	HAZİNE	11/04/23		0,00		1.070.000,00	123,077300	22/05/20	0,000000				107,693062	10.504.971,39	15,47	14,32	14,32
XS1691349010	USD	TC ZIRAAT BANKASI	29/09/23		1,10		200.000,00	100,311200	16/12/20	0,000000				101,640486	1.508.222,85	2,22	2,05	2,06
XS1917720911	USD	EXIMBANK	24/01/24		3,03		200.000,00	105,189600	11/02/19	0,000000				111,974500	1.661.567,21	2,45	2,26	2,27
XS1814962582	USD	EXIMBANK	03/05/24		8,87		200.000,00	89,516300	08/08/18	0,000000				103,443792	1.534.981,74	2,26	2,09	2,09
XS1634372954	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	21/06/24		6,25		400.000,00	98,129000	27/06/18	0,000000				102,074750	3.029.333,60	4,46	4,13	4,13

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. 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)
US900123CW86	USD	HAZİNE	14/11/24		0,44		550.000,00	100,469000	21/12/20	0,000000				105,742556	4.315.004,74	6,35	5,88	5,88
US900123AW05	USD	HAZİNE	05/02/25		0,16		100.000,00	112,344700	27/02/20	0,000000				114,774486	851.557,82	1,25	1,16	1,16
XS1843443356	EUR	HAZİNE	31/03/25		3,07		100.000,00	108,720700	29/11/19	0,000000				109,641589	999.536,58	1,47	1,36	1,36
XS1629918415	EUR	HAZİNE	14/06/25		4,22		150.000,00	94,352600	27/06/18	0,000000				103,169822	1.410.806,05	2,08	1,92	1,92
XS1909184753	EUR	HAZİNE	16/02/26		1,36		500.000,00	102,471100	22/05/20	0,000000				113,294240	5.164.178,07	7,60	7,04	7,04
US900123CJ75	USD	HAZİNE	14/04/26		5,01		100.000,00	95,967500	27/06/18	0,000000				100,209722	743.496,01	1,09	1,01	1,01
US900123CL22	USD	HAZİNE	25/03/27		5,44		200.000,00	105,350700	27/06/18	0,000000				107,960833	1.602.009,21	2,36	2,18	2,18
US900123CP36	USD	HAZİNE	17/02/28		0,74		200.000,00	80,340300	09/04/20	0,000000				103,390403	1.534.189,51	2,26	2,09	2,09
US900123CT57	USD	HAZİNE	26/04/29		0,08		500.000,00	100,035300	27/05/20	0,000000				117,100556	4.344.079,31	6,39	5,92	5,92
US900123AL40	USD	HAZİNE	15/01/30		5,61		150.000,00	158,074000	27/06/18	0,000000				151,522708	1.686.311,37	2,48	2,30	2,30
US900123AT75	USD	HAZİNE	14/02/34		5,84		45.000,00	124,906600	21/12/18	0,000000				122,805222	410.013,48	0,60	0,56	0,56
US900123AY60	USD	HAZİNE	17/03/36		0,25		200.000,00	93,248300	30/03/20	0,000000				111,173014	1.649.674,12	2,43	2,25	2,25
US900123BB58	USD	HAZİNE	05/03/38		3,42		200.000,00	114,048600	25/02/20	0,000000				115,134972	1.708.464,83	2,51	2,33	2,33
US900123CM05	USD	HAZİNE	11/05/47		2,68		200.000,00	80,033300	29/04/20	0,000000				96,359639	1.429.861,41	2,10	1,95	1,95
GRUP TOPLAMI							6.465.000,00							55.540.017,90		81,74	75,68	75,71
GRUP TOPLAMI							19.165.000,00							67.946.775,68		100,00	92,59	92,62
T.REPO																		
TRT160425T33	TL	HAZİNE	04/01/21		11,06		450.545,42	11,060000	31/12/20		453.920,00	737298421317117616	450.545,42	11,060000	450.136,29	22,61	0,61	0,61
TRT160425T33	TL	HAZİNE	04/01/21		11,06		540.654,51	11,060000	31/12/20		544.705,00	737298421317117615	540.654,51	11,060000	540.163,55	27,13	0,74	0,74
TRT261022T10	TL	HAZİNE	04/01/21		17,80		1.001.950,68	17,800000	31/12/20		431.815,00	737298421317120892	1.001.950,68	17,800000	1.000.487,31	50,26	1,36	1,36
GRUP TOPLAMI							1.993.150,61							1.990.787,15		100,00	2,71	2,71
GRUP TOPLAMI							1.993.150,61							1.990.787,15		100,00	2,71	2,71
MEVDUAT																		
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL		15/01/21		17,50		1.250.000,00		09/12/20				1.272.138,64	17,500000	1.263.725,35	45,63	1,72	1,72

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. 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 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)
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL		22/01/21		17,50		500.000,00		14/12/20				509.338,18	17,500000	504.296,15	18,20	0,69	0,69
T. HALK BANKASI A.Ş.	TL		02/02/21		18,75		1.000.000,00		28/12/20				1.018.488,94	18,750000	1.002.078,15	36,17	1,37	1,37
GRUP TOPLAMI							2.750.000,00							2.770.099,65		100,00	3,78	3,78
GRUP TOPLAMI							2.750.000,00							2.770.099,65		100,00	3,78	3,78
TÜREV																		
Futures																		
Kısa																		
F_USDTRY0121	TL						50,00	7,430400	29/12/20			80176126726189190		7,507500	375.375,00	0,00	0,00	0,00
Uzun																		
F_EURUSD0121	USD						200,00	1,231100	29/12/20			80176126726233510		1,228400	1.822.798,19	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							250,00							2.198.173,19		0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							250,00							2.198.173,19		0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																		
VIOP Nakit Teminatı															674.241,58	100,00	0,92	
GRUP TOPLAMI							674.241,58							674.241,58		100,00	0,92	
GRUP TOPLAMI							674.241,58							674.241,58		100,00	0,92	
DİĞER																		
Döviz																		
EUR	EUR	EU					14.637,30	9,268252	31/12/20					9,116400	133.439,48	0,00	0,00	0,18
USD	USD	FED					5.600,15	7,709036	31/12/20					7,419400	41.549,75	0,00	0,00	0,06
GRUP TOPLAMI							20.237,45							174.989,23		0,00	0,00	0,24

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. 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 ALISH 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						20.237,45									174.989,23	0,00	0,00	0,24
						FON PORTFÖY DEĞERİ									73.381.904,06		100,00	

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. 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	73.381.904	100	99,45	69.333.344	100	99,99
B. HAZİR DEĞERLER (+)	182.059	100	0,25	196.218	100	0,28
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	7.070	3,88	0,01	2.316	1,18	-
c) Diğer Hızır Değerler	174.989	96,12	0,24	193.902	98,82	0,28
C.ALACAKLAR (+)	-	-	-	-	-	-
a) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
D. BORÇLAR (-)	215.343	100	0,30	192.385	100	0,28
a) Takasa Borçlar	145.544	67,59	0,20	135.156	70,25	0,19
b) Yönetim Ücreti	64.848	30,11	0,10	55.259	28,72	0,09
c) Diğer Borçlar	2.751	1,30	-	1.971	1,03	-
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	73.348.620		100	69.337.177		100