

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş.
OKS Agresif Katılım Değişken
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 K: 2-3-4
34485 Sarıyer/İstanbul TÜRKİYE

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. OKS Agresif Katılım 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 Agresif Katılım 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 Agresif Katılım 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 Agresif Katılım Değişken 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)
HİSSE SENETLERİ																		
Hisse Türk																		
ALBRK	TL	ALBARAKA TÜRK KATILIM BANKASI A.Ş.			1,00		1,350000		09/10/20			8010051- 18881477100		1,940000	1,94	0,00	0,00	0,00
ALKIM	TL	ALKİM ALKALI KİMYA A.Ş.					14,020,21	12,901028	20/11/20			8010051- 17031982870		14,900000	208.901,13	2,18	1,08	1,05
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.					47.870,00	14,148967	07/10/20			8010051- 14985592230		18,250000	869.977,50	9,08	4,48	4,37
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.					2,400,00	18,250000	31/12/20			8010051- 14985592230		18,250000	43.800,00	0,46	0,22	0,22
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAGAZALAR A.Ş.					13,110,00	54,485580	16/11/20			8010051- 17293992910		75,500000	989.805,00	10,33	5,08	4,97
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.					96.680,00	10,239112	16/11/20			8010051- 17293999920		14,930000	1.443.432,40	15,08	7,43	7,25
GOODY	TL	GOODYEAR LASTİKLERİ T.A.Ş.					53.700,00	5,475838	18/11/20			8010051- 15016136380		8,360000	448.932,00	4,69	2,31	2,25
GOODY	TL	GOODYEAR LASTİKLERİ T.A.Ş.					-26.700,00	5,475838	31/12/20			8010051- 15016136380		8,360000	-223.212,00	-2,33	-1,15	-1,12

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Katılım Değişken Emeklilik Yatırım Fonu

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

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CNSİ	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 DÖNÜŞTÜRÜ	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HLGYO	TL	HALK GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.					0,95	1,042105	07/10/20			8010051- 18976063710		3,210000	3,05	0,00	0,00	0,00
ISDMR	TL						41,350,00	7,213605	11/12/20			8010051- 16038344180		10,110000	418,048,50	4,36	2,15	2,10
MAVİ	TL	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.					14,160,00	42,347195	02/12/20			8010051- 16512853740		52,200000	739,152,00	7,72	3,80	3,71
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.					6,000,00	58,150000	18/11/20			8010051- 14975005950		74,800000	447,600,00	4,67	2,30	2,25
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.					4,800,00	74,420000	31/12/20			8010051- 14975005950		74,600000	358,080,00	3,74	1,84	1,80
SELEC	TL	SELÇUK ECZA DEPOSU TİCARET VE SANAYİ A.Ş.					1,00	9,420000	02/12/20			8010051- 16494023410		13,650000	13,65	0,00	0,00	0,00
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.					81,400,00	10,756720	18/11/20			8010051- 14975538630		12,910000	1,050,874,00	10,97	5,41	5,28
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.					27,600,00	12,920000	31/12/20			8010051- 14975538630		12,910000	356,316,00	3,72	1,83	1,79

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Katılım Değişken 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 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)
BANKASI																		
A.Ş.																		
ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	TL		02/02/21		18,75		202.858,08		28/12/20				206.599,32	18,750000	203.273,77	26,22	1,05	1,02
GRUP TOPLAMI																		
GRUP TOPLAMI																		
766.823,54																		
766.823,54																		
DİĞER																		
Y.Fonu Türk																		
TPZ - TEB PORTFOY KIRA SERTEFİK ALARI (DÖVİZ) KATILIM FONU																		
TL		TEB PORTFOY YÖNETİMİ A.Ş.					40.000,00	2,478660	17/01/20					3,128911	125.156,44	100,00	0,64	0,63
GRUP TOPLAMI																		
GRUP TOPLAMI																		
40.000,00																		
40.000,00																		
KIRA SERTİFİKALARI																		
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları																		
TRD10022 1T17	TL	HAZINE	10/02/21		0,00		1.530.000,00	106,365900	16/12/20	14,440022		735704410160376675		107,203567	1.640.215,18	18,32	8,44	8,23
TRD16062 1T17	TL	HAZINE	16/06/21		0,00		430.000,00	104,307700	18/09/20	14,840336		733181574904337051		103,807353	446.371,62	4,99	2,30	2,24
TRD14072 1T18	TL	HAZINE	14/07/21		0,00		320.000,00	99,581700	07/10/20	14,800897		7339333640857807474		101,972552	326.312,20	3,64	1,68	1,64
TRD2092 1T16	TL	HAZINE	22/09/21		0,00		780.000,00	159,705200	22/04/20	0,450189		727283794533038852		175,973231	1.372.591,20	15,33	7,06	6,89
TRD15122 1T10	TL	HAZINE	15/12/21		0,00		1.250.000,00	103,706300	23/09/20	14,042175		733379486997127046		98,714535	1.233.931,89	13,78	6,35	6,19
TRD26012 2T19	TL	HAZINE	26/01/22		0,00		2.220.000,00	100,324000	30/12/20	13,716634		737258564020736560		100,781485	2.237.570,97	25,00	11,54	11,23
TRD06022 2T19	TL	HAZINE	09/02/22		0,00		160.000,00	105,825100	10/09/20	13,181787		731399816311660822		100,815202	161.304,32	1,80	0,83	0,81

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Katılım Değişken 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)
TRD11052 2T12	TL	HAZINE	11/05/22		0,00		100.000,00	94,852300	08/12/20	13,05859 8		73638802568931885 8		97,373739	97,373,74	1,09	0,50	0,49
TRD06072 2T17	TL	HAZINE	06/07/22		9,50		1.000.000,00	100,000000	08/07/20	14,63580 1				98,539880	985,398,60	11,01	5,07	4,95
TRD10082 2T10	TL	HAZINE	10/08/22		0,00		150.000,00	105,734700	10/08/20	14,79471 7		73163731082344652 6		99,305525	148,958,29	1,86	0,77	0,75
GRUP TOPLAMI							7.940.000,00								8.650.027,81	96,62	44,54	43,42
Özel Sektör Kira Sertifikaları																		
TRDYVKS A2119	TL	YATIRIM VARLIK KIRALAMA A.Ş.	24/12/21		16,56		300.000,00	100,000000	27/12/19	19,45950 7				100,89613 9	302,688,42	3,38	1,56	1,52
GRUP TOPLAMI							300.000,00								302,688,42	3,38	1,56	1,52
GRUP TOPLAMI							8.240.000,00								8.952,716,23	100,00	46,10	44,94
FON PORTFÖY DEĞERİ															19.432.150,78		100,00	

Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Katılım Değişken Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

	31.Ara.20			31 Aralık 2019		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	19.432.151	100,00	97,55	4.907.418	100,00	102,31
B. HAZIR DEĞERLER (+)	156.615	100,00	0,79	54.439	100,00	1,13
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	156.615	100,00	0,79	54.439	100,00	1,13
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR (+)	1.357.839	100,00	6,81	83.924	100,00	1,75
a) Takastan Alacaklar	1.357.608	99,98	6,81	76.104	91	1,59
b) Diğer Alacaklar	231	0,02	-	7.820	9,32	0,16
D. BORÇLAR (-)	1.025.741	100,00	5,15	249.334	100,00	5,20
a) Takasa Borçlar	914.811	89,19	4,59	226.296	90,76	4,72
b) Yönetim Ücreti	13.516	1,32	0,07	2.958	1,19	0,06
c) Diğer Borçlar	97.415	9,50	0,49	20.080	8,05	0,42
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	19.920.864		100,00	4.796.447		100,00