

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 HESAP DÖNEMİNE AİT
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA
UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR



TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu”)

PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. ZEM Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu’nun (eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu”) (“Fon”) Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan “Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına ilişkin Tebliğ (II-14.2)” hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca (“SPK”) belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu’nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Fon’un Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan “Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına ilişkin Tebliğ (II-14.2)” hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş.’nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.


Talar Gül, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 29 Nisan 2021

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değeri	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A. BORÇLANMA ARAÇLARI															
A.1. ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI															
Finansman Bonosu															
	Deniz Factoring	03.03.2021	TRFDZFK32115	16,29	5,00	3.600.000,00	100,00	-	17,58	-	101,109	-	3.639.920,760	1,65	0,71
	DENİZ GMYO	10.03.2021	TRFDZYO32126	16,29	12,00	6.200.000,00	100,00	-	17,58	-	100,786	-	6.248.709,060	2,83	1,22
	QNB FİNANS FAKTORİNG A.Ş.	26.01.2021	TRFFINF12112	15,02	25,00	1.650.000,00	96,57	-	16,12	-	98,979	-	1.633.148,880	0,74	0,32
	QNB FİNANSBANK	26.03.2021	TRFFNBK32115	13,80	21,00	11.000.000,00	99,87	-	14,70	-	100,610	-	11.067.122,770	5,02	2,16
	T.GARANTİ BANKASI AŞ	17.02.2021	TRFGRAN22129	15,71	19,00	4.200.000,00	100,00	-	16,90	-	100,530	-	4.222.254,090	1,91	0,83
	T.GARANTİ BANKASI AŞ	23.02.2021	TRFGRAN22137	16,91	26,00	4.000.000,00	99,96	-	18,30	-	100,149	-	4.005.972,000	1,82	0,78
	Halk Finansal Kiralama	15.01.2021	TRFHLFK12118	13,33	14,00	100.000,00	96,20	-	14,22	-	99,490	-	99.489,850	0,05	0,02
	İŞ FAKTORİNG A.Ş.	08.01.2021	TRFISFA12112	13,24	7,00	100.000,00	96,40	-	14,13	-	99,746	-	99.746,110	0,05	0,02
	NUROL YATIRIM BANKASI AŞ	05.02.2021	TRFNURL22119	15,52	35,00	2.000.000,00	96,22	-	16,65	-	98,530	-	1.970.593,590	0,89	0,39
	T.HALK BANKASI AŞ	12.02.2021	TRFTHAL22135	5,01	42,00	12.000.000,00	100,00	-	5,11	-	102,143	-	12.257.204,400	5,56	2,40
	T.İŞ BANKASI AŞ	07.01.2021	TRFTISB12129	12,69	6,00	3.000.000,00	96,82	-	13,51	-	99,791	-	2.993.739,880	1,36	0,59
	VAKIF FAKTORİNG A.Ş.	25.01.2021	TRFVFAS12123	14,66	24,00	2.130.000,00	96,46	-	15,71	-	99,042	-	2.109.603,010	0,96	0,41
	VAKIF FAKTORİNG A.Ş.	04.03.2021	TRFVFAS32113	17,14	62,00	3.200.000,00	95,91	-	18,40	-	97,164	-	3.109.231,760	1,41	0,61
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	21.01.2021	TRFVKFB12169	17,52	20,00	5.000.000,00	100,03	-	19,00	-	100,630	-	5.031.490,600	2,28	0,98
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	12.02.2021	TRFVKFB22143	14,04	42,00	12.000.000,00	100,00	-	14,80	-	102,144	-	12.257.263,320	5,56	2,40
	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	04.03.2021	TRFYAKF32114	16,74	62,00	3.900.000,00	96,00	-	17,95	-	97,227	-	3.791.852,680	1,72	0,74
	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	05.03.2021	TRFYAKF32130	18,44	63,00	1.400.000,00	96,76	-	19,90	-	96,908	-	1.356.709,720	0,62	0,27
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	08.01.2021	TRFYKBK12155	20,38	7,00	3.000.000,00	100,04	-	22,33	-	101,518	-	3.045.537,000	1,38	0,60
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	05.02.2021	TRFYKBK22147	20,16	35,00	5.000.000,00	100,00	-	22,05	-	100,465	-	5.023.249,200	2,28	0,98
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	26.02.2021	TRFYKBK22154	15,73	24,00	4.200.000,00	99,96	-	16,91	-	100,450	-	4.218.882,910	1,91	0,83
	Alternatif Bank	30.04.2021	TRFALNF42114	4,56	119,00	1.800.000,00	100,00	31.12.2020	4,63	-	100,052	-	1.800.938,270	0,82	0,35
ARA GRUP TOPLAMI						89.480.000,00							89.982.659,860	40,79	17,60
A.2. KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI															
Devlet Tahvili															
	HAZİNE	14.04.2021	TRT140421T13	14,76	103,00	15.500.000,00	95,02	-	15,55	-	95,992	-	14.878.777,600	6,75	2,91
	HAZİNE	17.02.2021	TRT170221T12	14,13	47,00	96.000.000,00	101,14	-	15,03	-	103,463	-	99.324.272,700	45,03	19,43
	HAZİNE	21.04.2021	TRT210421T14	14,68	110,00	15.500.000,00	104,66	-	15,44	-	105,759	-	16.392.601,750	7,43	3,21
ARA GRUP TOPLAMI						127.000.000,00							130.595.652,050	59,21	25,54
GRUP TOPLAMI						216.480.000,00							220.578.311,910	100,00	43,14
B. KİRA SERTİFİKALARI															
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	19.03.2021	TRDZKVK32120	15,58	77,00	36.000.000,00	100,00	-	16,51	-	101,001	-	36.360.283,980	100,00	7,11
GRUP TOPLAMI						36.000.000,00							36.360.283,980	100,00	7,11

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

C. DİĞER VARLIKLAR

C.1. Ters Repolar

-	04.01.2021	TRT080328T15	18,00	3,00	39.076.931,51	99,91	31.12.2020	19,70	39.035.945,00	99,957	-	39.019.218,670	15,34	7,63
-	04.01.2021	TRT080328T15	11,42	3,00	110.137,67	103,20	31.12.2020	12,09	106.588,00	103,233	-	110.034,400	0,04	0,02
-	04.01.2021	TRT080328T15	18,00	3,00	39.076.931,51	99,91	31.12.2020	19,70	39.035.945,00	99,957	-	39.019.218,670	15,34	7,63
-	04.01.2021	TRT110827T16	18,00	3,00	23.045.369,86	92,11	31.12.2020	19,70	24.969.525,00	92,158	-	23.011.334,090	9,04	4,50
-	04.01.2021	TRT280628T18	18,00	3,00	11.021.698,63	147,25	31.12.2020	19,70	7.470.165,00	147,325	-	11.005.420,650	4,33	2,15
-	04.01.2021	TRT280628T18	18,00	3,00	11.021.698,63	147,25	31.12.2020	19,70	7.470.165,00	147,325	-	11.005.420,650	4,33	2,15
-	04.01.2021	TRT280628T18	18,00	3,00	11.021.698,63	147,25	31.12.2020	19,70	7.470.165,00	147,325	-	11.005.420,650	4,33	2,15

ARA GRUP TOPLAMI **134.374.466,44** **134.176.067,780** **52,74** **26,24**

C.2. Borsa Para Piyasası

-	20.01.2021	-	9,32	19,00	2.092.252,05	-	21.07.2020	9,54	-	-	-	2.082.351,330	0,82	0,41
---	------------	---	------	-------	--------------	---	------------	------	---	---	---	---------------	------	------

ARA GRUP TOPLAMI **2.092.252,05** **2.082.351,330** **0,82** **0,41**

C.3. Vadeli Mevduat

ALTERNATİFBANK AŞ	06.01.2021	3AyaKadarVD-ANF-TRY	17,00	5,00	8.500.000,00	-	02.12.2020	18,37	-	17,000	-	8.618.359,930	3,39	1,69
ALTERNATİFBANK AŞ	04.01.2021	3AyaKadarVD-ANF-TRY	17,00	3,00	8.500.000,00	-	01.12.2020	18,37	-	17,000	-	8.622.338,330	3,39	1,69
TÜRK EKONOMİ BANKASI AŞ	06.01.2021	3AyaKadarVD-TEB-TRY	16,95	5,00	25.000.000,00	-	02.12.2020	18,31	-	16,950	-	25.347.094,560	9,96	4,96
T.GARANTİ BANKASI AŞ	04.01.2021	3AyaKadarVD-TGB-TRY	19,25	3,00	25.000.000,00	-	30.12.2020	21,20	-	19,250	-	25.026.385,000	9,84	4,89
T.İŞ BANKASI AŞ	19.01.2021	3AyaKadarVD-TİB-TRY	17,50	18,00	25.000.000,00	-	15.12.2020	18,95	-	17,500	-	25.202.927,590	9,91	4,93

ARA GRUP TOPLAMI **92.000.000,00** **92.817.105,410** **36,48** **18,15**

C.4. Kanlım Hesabı

TÜRKİYE EMLAK KATILIM BANKASI A.Ş.	04.01.2021	3AyaKadarVD-EKT-TRY	16,75	3,00	25.000.000,00	-	01.12.2020	16,75	-	16,750	-	25.355.650,680	9,97	4,96
------------------------------------	------------	---------------------	-------	------	---------------	---	------------	-------	---	--------	---	----------------	------	------

ARA GRUP TOPLAMI **25.000.000,00** **25.355.650,680** **9,97** **4,96**

GRUP TOPLAMI **253.466.718,49** **254.431.175,200** **100,00** **49,76**

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ **511.369.771,090** **100,00**

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2020			31 Aralık 2019		
	Tutar	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%	TL	%	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	511.369.771	100,00	100,02	499.019.229	100,00	99,90
B. HAZIR DEĞERLER	4.787	100,00	0,00	997	100,00	0,00
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	4.787	100,00	0,00	997	100,00	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	351.371	100,00	0,07	991.121	100,00	0,20
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	351.371	100,00	0,07	991.121	100,00	0,20
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	(454.183)	100,00	(0,09)	(503.428)	100,00	(0,10)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takasa Borçlar	-	-	-	-	-	-
e) Yönetim Ücreti	(393.259)	86,59	(0,08)	(430.943)	86,00	(0,09)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) SPK Kayda Alma Ücreti	(15.338)	3,38	(0,00)	-	-	-
h) Diğer Borçlar	(45.586)	10,04	(0,01)	(72.485)	14,00	(0,01)
Fon Toplam Değeri	511.271.746	100,00		499.507.919	100,00	
Toplam Katılma Payı/Pay Sayısı	500.000.000.000			500.000.000.000		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma Payı	481.307.991.125			479.884.890.838		
Fon toplam değeri (TL)	511.271.746			499.507.919		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	18.692.008.875			20.115.109.162		
Birim pay değeri (TL)	0,027352			0,024832		