

**AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**31 ARALIK 2018 TARİHİ İTİBARIYLA
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**



**AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM 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**

Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("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 İlişkin 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 2018 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun 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 İlişkin 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 Avivasa Emeklilik ve Hayat 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.


Adnan Akın, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 19 Nisan 2019

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
A)HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
AEFES	AEFES	-	-	-	-	160	25,70	7/3/2018	-	-	20,60	-	3.296	0,36	0,20
AKBNK	AKBANK T.A.S.	-	-	-	-	8.917	8,04	12/18/2018	-	-	6,86	-	61.171	6,65	3,63
AKGRT	AKGRT	-	-	-	-	2.763	3,74	12/18/2018	-	-	3,66	-	10.113	1,10	0,60
AKSA	AKSA	-	-	-	-	205	11,00	8/28/2018	-	-	7,46	-	1.529	0,17	0,09
ALKIM	ALKIM	-	-	-	-	672	23,49	12/28/2018	-	-	23,70	-	15.926	1,73	0,95
ANACM	ANACM	-	-	-	-	3.791	2,81	12/18/2018	-	-	2,68	-	10.160	1,10	0,60
ANSGR	ANSGR	-	-	-	-	1.471	4,38	12/18/2018	-	-	4,12	-	6.061	0,66	0,36
ARCLK	ARCLK	-	-	-	-	1.137	15,85	12/18/2018	-	-	15,79	-	17.953	1,95	1,07
ARENA	ARENA	-	-	-	-	78	4,46	5/28/2018	-	-	4,41	-	344	0,04	0,02
ASELS	ASELS	-	-	-	-	1.319	26,80	12/18/2018	-	-	24,08	-	31.762	3,45	1,89
ASELS	ASELS	-	-	-	-	200	23,98	12/31/2018	-	-	24,08	-	4.816	0,52	0,29
BIMAS	BIMAS	-	-	-	-	500	75,49	12/28/2018	-	-	87,00	-	43.500	4,73	2,59
CCOLA	CCOLA	-	-	-	-	540	31,26	12/28/2018	-	-	30,88	-	16.675	1,81	0,99
DOHOL	DOHOL	-	-	-	-	2.560	1,02	11/14/2018	-	-	1,02	-	2.611	0,28	0,15
ECILC	ECILC	-	-	-	-	113	4,44	2/14/2018	-	-	2,73	-	308	0,03	0,02
EKGYO	EMLAK GMYO	-	-	-	-	2.002	2,62	3/16/2018	-	-	1,50	-	3.003	0,33	0,18
ENJSA	ENERJISA ELEKTRİK	-	-	-	-	5.286	5,77	12/18/2018	-	-	5,10	-	26.959	2,93	1,60
ENKAI	ENKAI	-	-	-	-	462	4,92	10/25/2018	-	-	4,58	-	2.118	0,23	0,13
EREGL	EREGL	-	-	-	-	6.416	10,09	12/18/2018	-	-	7,22	-	46.324	5,03	2,75
FROTO	FROTO	-	-	-	-	100	65,05	12/28/2018	-	-	50,00	-	5.000	0,54	0,30
GARAN	T.GARANTİ BANKASI A.S.	-	-	-	-	8.500	8,77	12/28/2018	-	-	7,96	-	67.660	7,35	4,02
ISCTR	T.İŞ BANKASI A.S.	-	-	-	-	6.640	5,54	12/18/2018	-	-	4,53	-	30.079	3,27	1,79
ISMEN	İŞ YATIRIM	-	-	-	-	3.796	2,11	12/18/2018	-	-	2,06	-	7.820	0,85	0,47
KCHOL	KCHOL	-	-	-	-	1.600	15,44	12/28/2018	-	-	14,20	-	22.720	2,47	1,35
KORDS	KORDS	-	-	-	-	890	9,38	12/18/2018	-	-	9,78	-	8.704	0,95	0,52
KORDS	KORDS	-	-	-	-	750	9,50	12/31/2018	-	-	9,78	-	7.335	0,80	0,44
KOZAA	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK	-	-	-	-	200	6,14	12/18/2018	-	-	7,22	-	1.444	0,16	0,09
KOZAL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.	-	-	-	-	696	46,66	12/18/2018	-	-	51,30	-	35.705	3,88	2,12
KRDMD	KARDEMİR KARABUK DEMİR ÇELİK S.T.A.Ş.	-	-	-	-	5.000	3,84	12/28/2018	-	-	2,18	-	10.900	1,18	0,65
MAVI	MAVI JEANS	-	-	-	-	297	37,54	12/18/2018	-	-	32,22	-	9.569	1,04	0,57
MGROS	MİGROS TİCARET A.Ş.	-	-	-	-	1.319	16,79	12/18/2018	-	-	14,90	-	19.653	2,14	1,17
OTKAR	OTKAR	-	-	-	-	4	121,45	2/8/2018	-	-	88,25	-	353	0,04	0,02
PETKM	PETKM	-	-	-	-	3.095	5,86	12/18/2018	-	-	5,04	-	15.599	1,69	0,93
PGSUS	PGSUS	-	-	-	-	1.013	25,52	12/18/2018	-	-	22,92	-	23.218	2,52	1,38
SAHOL	SAHOL	-	-	-	-	3.550	9,15	12/18/2018	-	-	7,52	-	26.696	2,90	1,59
SISE	SISE	-	-	-	-	3.902	4,90	12/18/2018	-	-	5,67	-	22.124	2,40	1,31
SODA	SODA	-	-	-	-	3.572	6,29	12/18/2018	-	-	7,10	-	25.359	2,76	1,51
TAVHL	TAV	-	-	-	-	198	23,81	10/25/2018	-	-	23,92	-	4.736	0,51	0,28
TAVHL	TAV	-	-	-	-	300	23,48	12/31/2018	-	-	23,92	-	7.176	0,78	0,43

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
Hisse Türk(Devamı)															
TCELL	TCELL	-	-	-	-	3.840	13,10	12/18/2018	-	-	12,17	-	46.733	5,08	2,78
THYAO	THYAO	-	-	-	-	2.929	16,10	12/28/2018	-	-	16,11	-	47.186	5,13	2,80
TKFEN	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	-	-	-	861	19,80	12/18/2018	-	-	20,72	-	17.840	1,94	1,06
TOASO	TOASO	-	-	-	-	1.079	23,37	12/18/2018	-	-	16,90	-	18.235	1,98	1,08
TRKCM	TRKCM	-	-	-	-	1.919	4,10	10/25/2018	-	-	3,03	-	5.816	0,63	0,35
TSKB	TSKB	-	-	-	-	5.414	0,92	12/18/2018	-	-	0,81	-	4.385	0,48	0,26
TTKOM	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	-	-	-	9.825	3,98	12/28/2018	-	-	3,90	-	38.318	4,16	2,28
TUPRS	TUPRS	-	-	-	-	270	117,19	12/28/2018	-	-	116,70	-	31.509	3,42	1,87
VAKBN	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	-	-	-	-	8.140	4,34	12/28/2018	-	-	3,90	-	31.746	3,45	1,89
YATAS	YATAS	-	-	-	-	796	7,35	12/18/2018	-	-	4,47	-	3.556	0,39	0,21
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	-	-	-	-	11.558	1,97	12/18/2018	-	-	1,60	-	18.493	2,01	1,10
GRUP TOPLAMI													920.294	100,00	54,73
B)BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili															
TRT270319T13	HAZİNE	3/27/2019		97,15		159.000	99,21	12/18/2018	22,96	-	100,26	-	159.407	33,23	9,47
TRT100719T18	HAZİNE	7/10/2019		93,45		200.000	97,07	12/13/2018	21,72	-	98,34	-	196.686	41,01	11,63
TRT170822T15	HAZİNE	8/17/2022		63,50		25.000	63,91	11/14/2018	18,40	-	85,92	-	21.479	4,48	1,28
TRT240724T15	HAZİNE	7/24/2024		66,70		55.000	78,39	11/2/2018	17,15	-	77,29	-	42.510	8,86	2,53
GRUP TOPLAMI													420.082	87,58	24,91
Özel Sektör															
Finansman Bonosu															
TRFFNBK11937	FINANSBANK A.Ş.	1/4/2019		97,31		20.000	97,31	11/27/2018	25,81	-	99,81		19.962	4,16	1,19
TRFISFA11916	İŞ FAKTORİNG	1/7/2019		97,27		20.000	97,27	11/27/2018	26,25	-	99,62		19.924	4,15	1,18
TRFGRFK11911	GARANTİ LESAİNG	1/25/2019		95,99		20.000	95,99	11/27/2018	24,75		98,56		19.711	4,11	1,17
GRUP TOPLAMI													59.597	12,42	3,54
GRUP TOPLAMI													479.679	100,00	28,45
C)BORSA PARA PİYASASI															
TPP	-	1/2/2019	-	24,85		90.123	24,85	12/31/2018	-	-	24,36	-	90.062	100,00	5,35
GRUP TOPLAMI													90.062	100,00	5,35
D)DİĞER															
Y.Fonu Türk															
AFA - AK PORTFÖY AMERİKA YABANCI HİSSE SENEDİ		-	-	-	-	86.221	0,04	12/27/2017	-	-	0,05	-	4.241	3,95	0,25
AFT-AK PORTFÖY BRIC ÜLKELERİ YABANCI HİSSE SE		-	-	-	-	1.641.629	0,03	11/5/2018	-	-	0,03	-	46.145	42,94	2,74
AFV-AK PORTFÖY AVRUPA YABANCI HİSSE SENEDİ FONU	AKPORTFOY	-	-	-	-	112.104	0,03	12/28/2017	-	-	0,03	-	3.737	3,48	0,22
AKE-AK PORTFÖY EUROBOND (AMERİKAN DOLARI) BORÇLANMA ARAÇLARI FONU	AKPORTFOY	-	-	-	-	110.264	0,03	12/26/2017	-	-	0,04	-	4.367	4,06	0,26
AOY-AKPORTFÖY YABANCI HİSSE SENEDİ FONU	AKPORTFOY	-	-	-	-	828.711	0,07	11/5/2018	-	-	0,06	-	48.971	45,57	2,91
GRUP TOPLAMI													50.385	46,89	2,99

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal Faiz	Faiz Ödeme	Nominal Değer/	Birim Alış	Satın Alış	İç İskonto	Repo Teminat	Günlük Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
E)TÜREV															
Futures															
Uzun															
F_USDTRY0219	-	-	-	-	-	50	5,46	12/31/2018	-	-	5,46	-	272.925	0,00	0,00
F_XAUTRYM0219	-	-	-	-	-	850	226,33	12/31/2018	-	-	226,33	-	192.381	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI													465.306	0,00	0,00
F)VIOP Nakit Teminatı															
VIOP Nakit Teminatı	-	-	-	-	-	85.590	-	-	-	-	-	-	85.590	100,00	5,09
GRUP TOPLAMI													85.590	100,00	5,09
FON PORTFÖY DEĞERİ													1.683.085		100,00

**AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS AGRESİF DEĞİŞKEN
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

31 ARALIK 2018 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2018		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	1.683.085		101
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B,HAZIR DEĞERLER	1.782		-
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	1.782	100	-
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	8.926		1
a) Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-
i) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
iii) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	8.926	100	1
D,DİĞER VARLIKLAR	-		-
E,BORÇLAR	(33.651)		(2)
a) Takasa Borçlar	(18.965)	56	(1)
i) İleri Valörlü Takas Borçları	(18.965)	-	-
ii) İhbarlı Fon Takas Borçları	(7.932)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(1.098)	3	-
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Krediler	-	-	-
f) Diğer Borçlar	(5.606)	17	-
i) Denetim Reeskontu	(4.007)		-
ii) Diğer	(1.599)		-
g) Kayda Alma Ücreti	(50)	-	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-		-
Fon toplam değeri	1.660.142		100