

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.

**ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**(Eski unvanıyla “AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. UZUN VADELİ
BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)**

31 ARALIK 2019 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. ORTA VADELİ BORÇLANMA
ARAÇLARI 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. Orta Vadeli Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun (Eski unvanıyla "Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. Uzun Vadeli Borçlanma Araçları 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 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 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Avivasa Emeklilik Ve Hayat A.Ş. Orta Vadeli Borçlanma Araçları 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 Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 21 Nisan 2020

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. UZUN VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Net	Günlük			
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Sözleşme No	Teminat Tutarı	Dönüş Tutarı	Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)
HİSSE SENETLERİ																	
Hisse Türk																	
SAHOL	SAHOL							1	9	9.10.2019				801005113452009910	9,54	10	100,00
GRUP TOPLAMI								1								10	100,00
BORÇLANMA SENETLERİ																	
Devlet Tahvili																	
TRT150120T16	HAZİNE	15.01.2020			0,00		886.000	97,13	24.12.2019	10,58	0A052082000B7EC8			104,84		928.926	0,64
TRT050220T17	HAZİNE	5.02.2020			0,00		250.000	87,50	9.12.2019	10,54	09BB4C420006C2B4			102,71		256.771	0,18
TRT080720T19	HAZİNE	8.07.2020			95,30		3.850.000	91,63	11.12.2019	10,81	717387640126880728			103,97		4.002.931	2,77
TRT120820T12	HAZİNE	12.08.2020			106,41		6.000.000	104,72	9.09.2019	10,71	718218870917620712			116,12		6.966.923	4,83
TRT160920T25	HAZİNE	16.09.2020			91,27		9.500.000	89,76	11.12.2019	11,31	721385464405545820			92,68		8.804.619	6,10
TRT071020T23	HAZİNE	7.10.2020			90,70		8.500.000	90,59	25.11.2019	11,27	721385464405526943			92,13		7.831.217	5,43
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00		5.450.000	92,54	2019/12/2019	11,45	0A056882000D69E6			103,46		5.638.609	3,91
TRT210421T14	HAZİNE	21.04.2021			0,00		1.000.000	109,88	31.12.2019	11,47	09FB00420008C324			115,54		1.155.434	0,80
TRT220921T18	HAZİNE	22.09.2021			96,80		16.000.000	95,78	16.12.2019	11,61	722098222818463779			99,28		15.884.781	10,99
TRT201021T25	HAZİNE	21.10.2020			0,00		13.000.000	105,08	19.12.2019	11,77	0A05F882000D9D6F			106,41		13.833.487	9,59
TRT020322T17	HAZİNE	2.03.2022			87,50		13.000.000	90,14	19.07.2019	11,71	716279332405890662			102,90		13.376.639	9,27
TRT170822T15	HAZİNE	17.08.2022			87,55		7.000.000	83,91	1.10.2019	11,77	716556409336316115			102,31		7.161.783	4,96
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			92,70		2.000.000	91,69	12.12.2019	11,44	721821145888008224			96,48		1.929.692	1,34
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			101,20		8.000.000	96,79	17.12.2019	11,66	722216695196006486			107,64		8.611.001	5,97
TRT080323T10	HAZİNE	8.03.2023			0,00		1.000.000	75,40	23.12.2019	11,92	09FD1C82000798E6			90,55		905.529	0,63
TRT140623T19	HAZİNE	14.06.2023			0,00		700.000	95,30	29.08.2019	11,70	63335282:00C1BD86			114,21		799.446	0,55
TRT181023T19	HAZİNE	18.10.2023			16,95		105.984	111,39	30.04.2019	11,71				130,24		138.030	0,10
TRT200324T13	HAZİNE	24.03.2020			0,00		500.000	83,02	18.12.2019	11,86	09FFEC4200093446			99,17		495.872	0,34
TRT240724T15	HAZİNE	24.07.2024			0,00		9.000.000	81,14	24.12.2019	12,24	0A06D042000DF408			93,94		8.454.304	5,86
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00		8.700.000	89,28	13.12.2019	12,38	0A054482000B1251			97,95		8.521.504	5,91
TRT240227T17	HAZİNE	24.02.2027			0,00		2.500.000	88,05	7.11.2019	12,37	0A00344200087B37			98,94		2.473.615	1,71
TRT110827T16	HAZİNE	11.08.2027			0,00		5.200.000	86,82	23.12.2019	12,33	0A052082000AAC60			96,74		5.030.418	3,49
TRT080328T15	HAZİNE	8.03.2028			96,80		2.000.000	92,04	14.11.2019	12,35	720158684306773486			105,81		2.116.135	1,47
GRUP TOPLAMI							124.141.984									125.317.665,49	86,84

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. UZUN VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

					Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç		Borsa	Repo	Net	Günlük				
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Faiz	Ödeme		Deger/	Alış	Alış	İskonto		Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oranı	Sayısı		Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı		No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
Özel Sektör																				
Finansman Bonosu																				
TRDFKT22010	DORUK FAKTORING	12.02.2020			20,95			450.000	91,11	26.08.2019	19,50					97,97		440.869	0,31	0,25
TRFAKBK32013	AKBANK T.A.S.	26.03.2020			2,00			4.000.000	100,00	25.12.2019	0,00					100,20		4.008.200	2,78	2,25
TRSAKBK12117	AKBANK T.A.S.	29.01.2021			16,50			13.700.000	82,23	9.10.2019	16,11					85,11		11.659.693	8,08	6,54
GRUP TOPLAMI								18.150.000										16.108.761	11,17	9,04
Özel Sektör Tahvil																				
TRSYDAT72010	YDA INSAAT	22.07.2020			0,00			810.000	100,00	3.05.2017	21,91		01514			102,83		832.940	0,58	0,47
TRSCMSA32112	CIMSA	18.03.2021			24,87			640.000	100,00	21.03.2019	12,57					100,42		642.712	0,45	0,36
GRUP TOPLAMI								1.450.000										1.475.652	1,03	0,83
GRUP TOPLAMI								19.600.000										17.584.414	12,20	9,87
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet																				
TRPAKT262012	AKTİFBANK	16.06.2020			95,10			200.000	95,10	25.12.2019	11,10	722573211841372610				95,30		190.593	0,13	0,11
TRPAKT292019	AKTİFBANK	23.09.2020			92,24			100.000	92,24	25.12.2019	11,41	722573211841372991				92,43		92.430	0,06	0,05
TRPKYVFA2318	TKYB VARLIK FİNANSMAN FONU	7.12.2023			16,99			1.000.000	100,00	7.12.2018	14,56					110,58		1.105.831	0,77	0,62
GRUP TOPLAMI								1.300.000										1.388.854	0,96	0,78
GRUP TOPLAMI								145.041.984										144.290.933	100,00	80,96
T.REPO																				
TRT050624T19	HAZİNE	2.01.2020			11,36			9.005.602	11,36	31.12.2019		722810706353311481		9.001.015	9.005.602	11,38		9.002.796	56,25	5,05
TRT280628T18	HAZİNE	2.01.2020			11,36			7.004.357	11,36	31.12.2019		722810706353311482		5.996.320	7.004.357	11,38		7.002.174	43,75	3,93
GRUP TOPLAMI								16.009.959										16.004.970	100,00	8,98
MEVDUAT																				
T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.		2.01.2020			10,25			5.780.000		31.12.2019					5.783.237	10,25		5.781.614	100,00	3,24
GRUP TOPLAMI								5.780.000										5.781.614	100,00	3,24

**AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. UZUN VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)**

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Net	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Sözleşme No	Teminat Tutarı	Dönüş Tutarı	Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
TPP																		
TPP		2.01.2020			10,95		5.003.000	10,95	31.12.2019		229081		5.003.000	10,78		5.001.523	45,45	2,81
TPP		2.01.2020			10,90		6.003.584	10,90	31.12.2019		229082		6.003.584	10,78		6.001.811	54,55	3,37
GRUP TOPLAMI							11.006.584									11.003.334	100,00	6,18
VIOP Nakit Teminatı																		
VIOP Nakit Teminatı							1.139.919									1.139.919	100,00	0,64
GRUP TOPLAMI							1.139.919									1.139.919	100,00	0,64
FON PORTFOY DEGERİ																178.220.780		100,00

**AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. ORTA VADELİ BORÇLANMA
ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. UZUN VADELİ
BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)**

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2019		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	178.220.780		100
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B,HAZIR DEĞERLER	36.962		-
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	36.962	100	-
i) TL Hesaplar			
ii) Yabancı Para TL Karşılığı			
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)			
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	72.567		-
Takastan Alacaklar	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-		-
b) Takastan Alacaklar T2	-		-
c) İleri Valörlü Takas	-		-
d) Diğer Alacaklar	72.567		-
D,DİĞER VARLIKLAR			
E,BORÇLAR	(284.132)		-
a) Takasa Borçlar	-	-	-
i) Takasa Borçlar T1	-		
ii) Takasa Borçlar T2	-		
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-		
b) Yönetim Ücreti	(274.266)	97	-
c) İhtiyatlar	-	-	-
d) Kayda Alma ücreti	(5.343)	2	-
e) Diğer Borçlar	(4.524)	3	-
i) Denetim Ücreti	(2.735)		-
vi) Diğer	(1.788)		-
F. M.D.Düşüş Karşılığı			
Fon toplam değeri	178.046.178		100