

ATA PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON

**1 OCAK-31 ARALIK 2019 DÖNEMİNE AİT
FİYAT RAPORU**

ATA PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON

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

Ata Portföy Birinci Değişken Fonu'nun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla hazırlanan 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 İlişkin Tebliğ (II-14.2) ("Tebliğ") hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını SPK'nın konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Ata Portföy Birinci Değişken Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer / net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları, yukarıda belirtilen hususun etkileri haricinde tebliğ hükümlerine ve SPK tarafından belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen SPK, Kurucu Yönetim Kurulu ve Ata Portföy Yönetimi A.Ş.'nin ("Kurucu") bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
Member of DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED

Okan Öz, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 29 Nisan 2020

31/12/2019 Tarihli Ata Portföy Birinci Değişken Fon

Fon Toplam Değer Raporu

	TUTARI(TL)	Grup (%)	Toplam (%)		TUTARI(TL)	Grup (%)	Toplam (%)
MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	4.212.449				FON TOPLAM DEĞERİ	4.199.077	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	4.212.449		100,32%		Toplam Pay Sayısı	15.000.000.000	
B. HAZIR DEĞERLER	-		0,00%		Dolaşımdaki Pay Sayısı	566.091.342	
b) Bankalar	-	0,00%	0,00%		Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	-	
i) TL Hesaplar	-	0,00%	0,00%		Merkezdeki Pay Sayısı	14.433.908.658	
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	0,00%	0,00%		Fiyat	0,007418	
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	0,00%	0,00%		(VOB AçıkPozisyon)	3.334.671	79,41%
c) Diğer Hazır Değerler	-	0,00%	0,00%		Pay Sahibi Sayısı	-	
C. ALACAKLAR	-		0,00%		Günlük Yönetim Ücreti	345	
Takastan AlacaklarT1	-	0,00%	0,00%		Dünkü Fiyat	0,01	0,18%
Takastan AlacaklarT2	-	0,00%	0,00%				
Diğer Alacaklar	-	0,00%	0,00%				
D. DİĞER VARLIKLAR	-		0,00%				
Diğer Varlıklar	-	0,00%	0,00%				
E. BORÇLAR	13.372		-0,32%				
Takasa BorçlarT1	-	0,00%	0,00%				
Takasa BorçlarT2	-	0,00%	0,00%				
Yönetim Ücreti	3.035	22,70%	-0,07%				
Odenecek Vergi	-	0,00%	0,00%				
İhtiyatlar	-	0,00%	0,00%				
Krediler	-	0,00%	0,00%				
Diğer Borçlar	10.336	77,30%	-0,25%				
1)Denetim Ücreti	3.056	22,86%	-0,07%				
2)Ödenecek Takas Saklama Komisyonu	160	1,20%	0,00%				
3)Ödenecek SPK kayda alma ücreti	-	0,00%	0,00%				
4)Noter Masrafı	-	0,00%	0,00%				
5)İlan Giderleri	-	0,00%	0,00%				
6)Diğer	7.120	53,25%	-0,17%				
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-		0,00%				
FON TOPLAM DEĞERİ	4.199.077						

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	İtfa Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)	Depo	VKG
A.HİSSE SENEDİ																			
	T.C.		AGHOL			6.683,00	16,90616	31.12.2019				17,59	1	117.553,97	3,34%	2,79%	2,8	SRB	0
	T.C.		AKBNK			19.842,00	8,130648	31.12.2019				8,11	1	160.918,62	4,58%	3,82%	3,83	SRB	0
	T.C.		AKCNS			6.212,00	10,095378	31.12.2019				10,04	1	62.368,48	1,77%	1,48%	1,49	SRB	0
	T.C.		AKGRT			12.685,00	5,819685	31.12.2019				6,09	1	77.251,65	2,20%	1,83%	1,84	SRB	0
	T.C.		ALKIM			1.969,00	34,866045	31.12.2019				38,32	1	75.452,08	2,15%	1,79%	1,8	SRB	0
	T.C.		ANACM			17.807,00	3,526435	31.12.2019				4,36	1	77.638,52	2,21%	1,84%	1,85	SRB	0
	T.C.		ARCLK			3.045,00	19,543487	31.12.2019				20,84	1	63.457,80	1,80%	1,51%	1,51	SRB	0
	T.C.		AYGAZ			9.685,00	12,203873	31.12.2019				12,84	1	124.355,40	3,54%	2,95%	2,96	SRB	0
	T.C.		BAGFS			3.722,00	14,693404	31.12.2019				16,82	1	62.604,04	1,78%	1,49%	1,49	SRB	0
	T.C.		BIZIM			15.381,00	10,548625	31.12.2019				11,17	1	171.805,77	4,88%	4,08%	4,09	SRB	0
	T.C.		CCOLA			2.875,00	35,88665	31.12.2019				38,7	1	111.262,50	3,16%	2,64%	2,65	SRB	0
	T.C.		CIMSA			7.784,00	9,076868	31.12.2019				9,08	1	70.678,72	2,01%	1,68%	1,68	SRB	0
	T.C.		DOAS			8.816,00	9,750095	31.12.2019				9,52	1	83.928,32	2,39%	1,99%	2	SRB	0
	T.C.		EKGYO			66.470,00	1,488872	31.12.2019				1,46	1	97.046,20	2,76%	2,30%	2,31	SRB	0
	T.C.		EREGL			28.273,00	8,112617	31.12.2019				9,04	1	255.587,92	7,27%	6,07%	6,09	SRB	0
	T.C.		GARAN			22.967,00	10,325257	31.12.2019				11,14	1	255.852,38	7,27%	6,07%	6,09	SRB	0
	T.C.		GOZDE			14.336,00	4,269793527	31.12.2019				5,14	1	73.687,04	2,10%	1,75%	1,75	SRB	0
	T.C.		MAVI			3.784,00	50,208405	31.12.2019				57,9	1	219.093,60	6,23%	5,20%	5,22	SRB	0
	T.C.		MEDYA			760	8,694737	01.01.2019				0	1	0	0,00%	0,00%	0	SRB	0
	T.C.		MGROS			11.372,00	22,857431	31.12.2019				24,22	1	275.429,84	7,83%	6,54%	6,56	SRB	0
	T.C.		ODAS			29.088,00	1,879991	31.12.2019				2,1	1	61.084,80	1,74%	1,45%	1,45	SRB	0
	T.C.		ÖZKGY			41.584,00	2,472335	31.12.2019				2,57	1	106.870,88	3,04%	2,54%	2,55	SRB	0
	T.C.		PGSUS			846	75,094465	31.12.2019				86,4	1	73.094,40	2,08%	1,74%	1,74	SRB	0
	T.C.		SABAH			1.030,00	2,856796	01.01.2019				0	1	0	0,00%	0,00%	0	SRB	0
	T.C.		SİSE			13.852,00	5,224743	31.12.2019				5,27	1	73.000,04	2,08%	1,73%	1,74	SRB	0
	T.C.		SODA			11.595,00	6,08674	31.12.2019				6,18	1	71.657,10	2,04%	1,70%	1,71	SRB	0
	T.C.		TCELL			5.054,00	13,372787	31.12.2019				13,8	1	69.745,20	1,98%	1,66%	1,66	SRB	0
	T.C.		THYAO			8.475,00	14,076998	31.12.2019				14,46	1	122.548,50	3,48%	2,91%	2,92	SRB	0
	T.C.		TOASO			3.163,00	25,54674	31.12.2019				26,86	1	84.958,18	2,42%	2,02%	2,02	SRB	0
	T.C.		TTKOM			11.850,00	7,170201	31.12.2019				7,37	1	87.334,50	2,48%	2,07%	2,08	SRB	0
	T.C.		TTRAK			3.189,00	52,161965	31.12.2019				55,4	1	176.670,60	5,02%	4,19%	4,21	SRB	0
	T.C.		ULKER			6.894,00	21,810144	31.12.2019				22,36	1	154.149,84	4,38%	3,66%	3,67	SRB	0
GRUP TOPLAMI						401.088,00								3.517.086,89		83,49%	83,76		
B.BORÇLANMA SENETLERİ																			
C.KATILMA BELGESİ																			
D.OPSIYON İŞLEMLER																			
E.YABANCI HİSSE																			
F.TERS REPO																			
G.KATILIM HESABI																			
H.VADELİ MEVDUAT																			
I.KİYMETLİ MADEN																			
J.YABANCI TAHVİL																			
K.BORSA PARA PİYASASI																			
L.VARANT İŞLEMLERİ																			
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																			
			Teminat			695.361,96	1	31.12.2019				1	1	695.361,96	100,00%	16,51%	16,56	VİOP TEMİNAT	0
GRUP TOPLAMI						695.361,96								695.361,96		16,51%	16,56		
N.SWAP																			
O.EUROBOND REPO																			
FON PORTFÖY DEĞERİ						1.096.449,96					0			4.212.448,85			100,32		0
DÖVİZ BAKİYELERİ																			
			TRY			0	1	31.12.2019				1	1	0	0,00%	0,00%	0	SRB	0
GRUP TOPLAMI						0								0			0,00%	0	
VOB SÖZLEŞMELERİ																			
	Uzun	28.02.2020	F_XAUTRYM0220 (LONG)			4.700,00	295,527947	30.12.2019				297,63	1	0	0,00%	0,00%	0	SRB	59
	Kısa	28.02.2020	F_XU0300220 (SHORT)			-137	139,966606	27.12.2019				141,3	1	0	0,00%	0,00%	0	SRB	59
GRUP TOPLAMI						4.563,00								0			0,00%	0	