

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
UZUN VADELİ DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM 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

**AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. UZUN VADELİ DIŞ
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. Uzun Vadeli Dış Borçlanma Araçları 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 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. Uzun Vadeli Dış 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, 26 Nisan 2021

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
UZUN VADELİ DİŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-4
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	5

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
UZUN VADELİ DİŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM 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 Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
BORÇLANMA SENETLERİ															
Eurobond Türk	HAZINE	26/09/22	US900123BZ27	5,14	-	10.234.000	102,48	15/12/20	0,00	-	106,488800	-	80.857.095	3,44	3,16
	HAZINE	23/03/23	US900123CA66	4,14	-	2.031.000	98,60	24/11/20	0,00	-	100,777200	-	15.185.916	0,65	0,59
	HAZINE	11/04/23	XS1057340009	2,88	-	14.675.000	106,88	18/11/20	0,00	-	107,702200	-	144.087.417	6,13	5,64
	HAZINE	25/12/23	US900123CR91	0,00	-	18.450.000	104,32	22/12/20	0,00	-	109,562100	-	149.977.291	6,38	5,87
	HAZINE	22/03/24	US900123CF53	5,45	-	12.964.000	101,13	15/12/20	0,00	-	107,097800	-	103.012.128	4,38	4,03
	HAZINE	12/08/24	US900123CV04	6,19	-	12.230.000	101,92	29/12/20	0,00	-	109,995600	-	99.809.196	4,24	3,91
	HAZINE	14/11/24	US900123CW86	4,89	-	10.600.000	100,07	24/11/20	0,00	-	105,858100	-	83.252.780	3,54	3,26
	HAZINE	05/02/25	US900123AW05	4,39	-	4.678.000	104,84	30/12/20	0,00	-	114,795000	-	39.842.995	1,69	1,56
	HAZINE	31/03/25	XS1843443356	4,60	-	15.025.000	106,61	13/08/20	0,00	-	109,644700	-	150.184.633	6,39	5,88
	HAZINE	16/06/25	XS1629918415	3,59	-	7.320.000	98,99	02/12/20	0,00	-	103,165000	-	68.844.117	2,93	2,69
	HAZINE	14/10/25	US900123CZ18	4,91	-	7.112.000	101,58	10/12/20	0,00	-	109,658500	-	57.863.252	2,46	2,26
	HAZINE	16/02/26	XS1909184753	6,01	-	1.540.000	102,28	13/10/20	0,00	-	113,307900	-	15.907.586	0,68	0,62
	HAZINE	09/10/26	US900123CK49	4,80	-	6.006.000	94,27	28/12/20	0,00	-	102,499400	-	45.674.672	1,94	1,79
	HAZINE	25/03/27	US900123CL22	5,02	-	11.150.000	101,29	28/12/20	0,00	-	107,877500	-	89.243.075	3,79	3,49
	HAZINE	17/02/28	US900123CP36	4,99	-	750.000	101,84	29/12/20	0,00	-	103,404600	-	5.754.001	0,24	0,23
	HAZINE	24/10/28	US900123CQ19	5,64	-	10.050.000	97,24	15/12/20	0,00	-	107,986400	-	80.520.027	3,42	3,15
	HAZINE	26/04/29	US900123CT57	5,81	-	21.075.000	105,42	10/12/20	0,00	-	117,221700	-	183.292.369	7,79	7,17
	HAZINE	15/01/30	US900123AL40	6,71	-	1.620.000	144,81	14/10/20	0,00	-	151,555200	-	18.216.068	0,77	0,71
	HAZINE	14/02/34	US900123AT75	7,43	-	5.810.000	120,54	01/10/20	0,00	-	122,827400	-	52.946.856	2,25	2,07
	HAZINE	17/03/36	US900123AY60	6,13	-	16.943.000	96,30	22/12/20	0,00	-	111,192100	-	139.776.136	5,94	5,47
	HAZINE	05/03/38	US900123BB58	6,23	-	9.020.000	114,15	24/12/20	0,00	-	115,155100	-	77.065.234	3,28	3,02
	HAZINE	30/05/40	US900123BG46	7,65	-	11.130.000	99,99	03/12/20	0,00	-	107,513300	-	88.782.249	3,78	3,47
	HAZINE	14/01/41	US900123BJ84	6,22	-	10.547.000	89,34	29/12/20	0,00	-	101,767800	-	79.635.758	3,39	3,12
	HAZINE	16/04/43	US900123CB40	6,06	-	650.000	84,13	03/12/20	0,00	-	88,983100	-	4.291.308	0,18	0,17
	HAZINE	17/02/45	US900123CG37	7,40	-	7.930.000	96,98	29/12/20	0,00	-	107,487500	-	63.241.176	2,69	2,47
	HAZINE	13/05/47	US900123CM05	6,68	-	15.460.000	86,84	22/12/20	0,00	-	96,375600	-	110.546.595	4,70	4,33
ARA GRUP TOPLAMI						245.000.000							2.047.809.927	87,88	80,13

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
UZUN VADELİ DİŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM 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 Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Aış Fiyatı	Satın Aış Tarihi	İç İskonto Oran	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
Eurobond Yabancı	T.İŞ BANKASI A.S.	25/06/21	XS1079527211	4,51	-	360.000	102,71	23/12/20	0,00	-	100,843300	-	2.693.508	0,11	0,11
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	27/10/21	XS1508914691	5,13	-	720.000	101,02	14/12/20	0,00	-	102,074300	-	5.452.776	0,23	0,21
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	24/02/22	XS1571399754	6,27	-	2.000.000	100,62	13/11/20	0,00	-	103,554500	-	15.366.245	0,65	0,60
	T.İŞ BANKASI A.S.	21/04/22	XS1508390090	4,76	-	5.180.000	100,08	31/12/20	0,00	-	102,559400	-	39.416.133	1,68	1,54
	TC ZİRAAT BANKASI	03/05/22	XS1605397394	5,25	-	5.950.000	99,26	29/12/20	0,00	-	101,516200	-	44.814.763	1,91	1,75
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/05/22	XS1622626379	5,75	-	6.110.000	101,19	25/11/20	0,00	-	101,620400	-	46.067.102	1,96	1,80
	TSKB	16/01/23	XS1750996206	5,83	-	3.140.000	100,46	14/12/20	0,00	-	102,970800	-	23.989.021	1,02	0,94
	VAKFN	30/01/23	XS1760780731	5,71	-	2.050.000	101,02	18/12/20	0,00	-	103,419800	-	15.729.914	0,67	0,62
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	16/03/23	XS1788516679	5,23	-	2.220.000	102,73	29/12/20	0,00	-	104,224200	-	17.166.839	0,73	0,67
	TC ZİRAAT BANKASI	29/09/23	XS1691349010	5,42	-	360.000	100,44	23/12/20	0,00	-	101,499200	-	2.711.027	0,12	0,11
	EXİMBANK	24/10/23	XS1496463297	7,49	-	500.000	94,68	10/11/20	0,00	-	102,003300	-	3.784.016	0,16	0,15
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	28/03/24	XS1970705528	6,03	-	2.810.000	106,42	29/12/20	0,00	-	109,179500	-	22.762.303	0,97	0,89
	T.İŞ BANKASI A.S.	25/04/24	XS1578203462	6,13	-	1.175.000	100,60	03/12/20	0,00	-	103,173400	-	8.994.446	0,38	0,35
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	15/10/24	XS1958649854	7,57	-	346.000	104,47	13/11/20	0,00	-	111,518200	-	2.862.798	0,12	0,11
	AKBANK T.A.S.	06/02/26	XS2131335270	6,90	-	3.125.000	100,04	08/07/20	0,00	-	109,248300	-	25.329.901	1,08	0,99
ARA GRUP TOPLAMI						36.046.000							277.140.793	11,79	10,84
Özel Sektör															
Finansman Bonosu	AKBANK T.A.S.	20/01/21	TRFAKBK12148	0,00	-	5.350.000	97,39	17/11/20	16,56	-	99,205345	-	5.307.486	0,23	0,21
	AKBANK T.A.S.	02/02/21	TRFAKBK22139	96,68	-	1.950.000	96,50	15/10/20	15,95	-	98,710916	-	1.924.863	0,08	0,08
ARA GRUP TOPLAMI						7.300.000							7.232.349	0,31	0,28
Özel Sektör Tahvil	ENERJİSA ELEKTRİK	23/02/21	TRSENJR22110	100,44	-	1.500.000	162,44	15/10/20	4,10	-	169,433343	-	2.541.500	0,11	0,10
	OTOKOÇ	15/03/21	TRSOTKO32110	99,99	-	1.500.000	101,13	15/10/20	18,31	-	100,832583	-	1.512.489	0,06	0,06
ARA GRUP TOPLAMI						3.000.000							4.053.989	0,17	0,16
GRUP TOPLAMI						10.300.000							11.286.338	0,48	0,44

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
UZUN VADELİ DİŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM 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 Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
İleri Valörlü Alışlar Yabancı															
Eurobond Türk	HAZİNE	14/10/25	US900123CZ18	4,54	-	515.000	109,23	05/01/21	-	-	109,658500	-	4.190.041	0,18	0,16
	HAZİNE	15/01/31	US900123DA57	5,50	-	520.000	104,55	05/01/21	-	-	104,967300	-	4.049.731	0,17	0,16
	HAZİNE	13/05/47	US900123CM05	6,11	-	1.000.000	96,11	05/01/21	-	-	96,375600	-	7.150.491	0,30	0,28
ARA GRUP TOPLAMI						2.035.000							15.390.264	0,65	0,60
GRUP TOPLAMI						293.381.000							2.351.627.322	100,00	92,02
T.REPO	HAZİNE	04/01/21	TRT070727T13	17,80	-	10.019.507	17,80	31/12/20	-	6.096.820,00	17,800000	-	10.004.873	12,50	0,39
	HAZİNE	04/01/21	TRT070727T13	17,80	-	20.039.014	17,80	31/12/20	-	12.193.640,00	17,800000	-	20.009.746	25,00	0,78
	HAZİNE	04/01/21	TRT170724T14	17,81	-	9.017.566	17,81	31/12/20	-	9.027.410,00	17,810000	-	9.004.388	11,25	0,35
	HAZİNE	04/01/21	TRT170724T14	17,81	-	10.019.518	17,81	31/12/20	-	10.030.455,00	17,810000	-	10.004.876	12,50	0,39
	HAZİNE	04/01/21	TRT170724T14	17,81	-	10.019.518	17,81	31/12/20	-	10.030.455,00	17,810000	-	10.004.876	12,50	0,39
	HAZİNE	04/01/21	TRT170724T14	17,76	-	10.019.463	17,76	31/12/20	-	10.030.400,00	17,760000	-	10.004.862	12,50	0,39
	HAZİNE	04/01/21	TRT170724T14	17,76	-	10.019.463	17,76	31/12/20	-	10.030.400,00	17,760000	-	10.004.862	12,50	0,39
	HAZİNE	04/01/21	TRT261022T10	17,80	-	1.001.951	17,80	31/12/20	-	431.815,00	17,800000	-	1.000.487	1,25	0,04
GRUP TOPLAMI						80.155.999							80.038.971	100,00	3,13
MEVDUAT	AKBANK T.A.S.	04/01/21	-	-	-	2.690.000	-	31/12/20	-	-	0,150000	-	19.958.268	21,16	0,78
	AKBANK T.A.S.	04/01/21	-	-	-	5.779.000	-	31/12/20	-	-	0,050000	-	52.683.748	55,87	2,06
	AKBANK T.A.S.	04/01/21	-	-	-	21.650.000	-	31/12/20	-	-	17,250000	-	21.660.308	22,97	0,85
GRUP TOPLAMI						30.119.000							94.302.324	100,00	3,69

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
UZUN VADELİ DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM 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 Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
TÜREV															
Futures															
Uzun	-	-	F_EURUSD0121	-	-	5,750	1,23	30/12/20	-	-	1,228400	-	52.405.448	0,00	0,00
	-	-	F_EURUSD0221	-	-	9.000	1,23	30/12/20	-	-	1,229400	-	82.092.693	0,00	0,00
Kısa	-	-	F_USDTRY0121	-	-	9.250	7,43	28/12/20	-	-	7,507500	-	69.444.375	0,00	0,00
	-	-	F_USDTRY0221	-	-	6.750	7,51	28/12/20	-	-	7,583700	-	51.189.975	0,00	0,00
	-	-	F_USDTRY0321	-	-	4.050	7,62	31/12/20	-	-	7,692200	-	31.153.410	0,00	0,00
	-	-	F_USDTRY0421	-	-	2.300	7,71	31/12/20	-	-	7,771100	-	17.873.530	0,00	0,00
	-	-	F_USDTRY0521	-	-	754	7,78	31/12/20	-	-	7,869000	-	5.933.226	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						37.854							310.092.657	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı															
-	-	-	-	-	-	29.662.564	-	-	-	-	-	-	29.662.564	100,00	1,16
GRUP TOPLAMI						29.662.564							29.662.564	100,00	1,16
VIOP USD Nakit Teminatı															
-	-	-	-	-	-	0	-	-	-	-	-	-	0	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						0							0	100,00	0,00
Diğer															
Döviz	EU	-	EUR	-	-	712	9,007909	31/12/20	-	-	9,116400	-	6.490	0,00	0,00
	FED	-	USD	-	-	909	7,340521	31/12/20	-	-	7,419400	-	6.744	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1.621							13.234	0,00	0,00
FON PORTFÖY DEĞERİ						433.318.563							2.555.631.180,52		100,00

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.**UZUN VADELİ DİŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU****31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU**

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

	31 Aralık 2020		Toplam %
	Tutar TL	Grup %	
A,FON PORTFOY DEGERI	2.555.631.181	-	100,93
(MIZANDAN PORTFOY DEGERI	-	-	-
B,HAZIR DEGERLER	27.516	-	-
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	14.282	51,90	-
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alaca	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	13.234	48,10	-
C,ALACAKLAR	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(23.604.750)	-	(0,93)
a)Takasa Borçlar	(15.365.756)	65,10	(0,61)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii)İleri Valörlü Taas	(15.365.756)	65,10	(0,61)
iv)İhbarlı FonPay Takas	(5.954.598)	25,23	(0,24)
b) Yönetim Ücreti	(2.189.720)	9,28	(0,09)
c) Odenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Krediler	-	-	-
f) Diğer Borçlar	(18.682)	0,40	-
i) Denetim Ücreti	(14.098)	0,06	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(4.584)	0,02	-
ı)Kayda Alma Ücreti	(75.993)	0,32	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	2.532.053.946		100,00