

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
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



**AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. 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. 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. 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.
DIŞ 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.
DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Kur	Deger	(%)	(%)
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger				
EUROBOND TÜRK	HAZİNE	25/03/22	US900123BY51	4,97	-	2.177.000	100,308700	09/11/20	-	-	104,07	-	16.808.808	0,63	0,59
	HAZİNE	26/09/22	US900123BZ27	0,00	-	8.510.000	102,012500	22/10/20	-	-	106,49	-	67.236.064	2,53	2,34
	HAZİNE	23/03/23	US900123CA66	0,00	-	4.426.000	93,252600	22/12/20	-	-	100,78	-	33.093.483	1,24	1,15
	HAZİNE	11/04/23	XS1057340009	2,88	-	17.225.000	108,232100	18/11/20	-	-	107,70	-	169.124.754	6,36	5,90
	HAZİNE	25/12/23	US900123CR91	0,00	-	24.250.000	104,877000	22/12/20	-	-	109,56	-	197.124.623	7,41	6,87
	HAZİNE	12/08/24	US900123CV04	6,53	-	8.000.000	102,337300	25/09/20	-	-	110,00	-	65.288.108	2,45	2,28
	HAZİNE	14/11/24	US900123CW86	5,89	-	5.651.000	98,183400	09/11/20	-	-	105,86	-	44.383.157	1,67	1,55
	HAZİNE	05/02/25	US900123AW05	6,59	-	8.470.000	105,978600	24/11/20	-	-	114,80	-	72.139.839	2,71	2,52
	HAZİNE	13/03/25	US900123CX69	5,80	-	5.800.000	94,828900	08/10/20	-	-	101,60	-	43.721.686	1,64	1,52
	HAZİNE	31/03/25	XS1843443356	4,53	-	19.153.000	103,688700	09/07/20	-	-	109,64	-	191.446.674	7,20	6,68
	HAZİNE	16/06/25	XS1629918415	4,90	-	2.850.000	96,938300	09/10/20	-	-	103,17	-	26.804.062	1,01	0,93
	HAZİNE	14/10/25	US900123CZ18	5,19	-	8.874.000	104,762300	03/12/20	-	-	109,66	-	72.198.888	2,71	2,52
	HAZİNE	16/02/26	XS1909184753	5,44	-	5.430.000	105,011700	02/10/20	-	-	113,31	-	56.089.736	2,11	1,96
	HAZİNE	14/04/26	US900123CJ75	4,59	-	3.650.000	92,950300	22/12/20	-	-	100,23	-	27.144.044	1,02	0,95
	HAZİNE	09/10/26	US900123CK49	6,18	-	9.990.000	95,042900	14/09/20	-	-	102,50	-	75.972.356	2,86	2,65
	HAZİNE	25/03/27	US900123CL22	5,06	-	17.772.000	102,276600	21/12/20	-	-	107,88	-	142.244.657	5,35	4,96
	HAZİNE	17/02/28	US900123CP36	0,00	-	1.910.000	99,768500	29/12/20	-	-	103,40	-	14.653.522	0,55	0,51
	HAZİNE	24/10/28	US900123CQ19	6,64	-	15.341.000	97,653500	23/11/20	-	-	107,99	-	122.911.217	4,62	4,29
	HAZİNE	26/04/29	US900123CT57	5,89	-	16.418.000	105,273300	23/11/20	-	-	117,22	-	142.789.756	5,37	4,98
	HAZİNE	15/01/30	US900123AL40	7,68	-	1.652.000	155,631000	23/01/20	-	-	151,56	-	18.575.892	0,70	0,65
	HAZİNE	15/01/31	US900123DA57	5,57	-	3.400.000	101,812800	28/12/20	-	-	104,97	-	26.479.009	1,00	0,92
	HAZİNE	14/02/34	US900123AT75	7,46	-	5.944.000	114,472400	25/11/20	-	-	122,83	-	54.168.006	2,04	1,89
	HAZİNE	17/03/36	US900123AY60	0,00	-	22.217.000	98,029600	29/12/20	-	-	111,19	-	183.285.510	6,89	6,39
	HAZİNE	05/03/38	US900123BB58	6,45	-	4.648.000	107,152400	24/11/20	-	-	115,16	-	39.711.664	1,49	1,38
	HAZİNE	30/05/40	US900123BG46	6,24	-	9.950.000	101,925900	22/12/20	-	-	107,51	-	79.369.576	2,98	2,77
	HAZİNE	14/01/41	US900123BJ84	6,34	-	10.220.000	86,188800	23/11/20	-	-	101,77	-	77.166.725	2,90	2,69
	HAZİNE	16/04/43	US900123CB40	6,04	-	1.970.000	83,537500	23/11/20	-	-	88,98	-	13.005.964	0,49	0,45
	HAZİNE	17/02/45	US900123CG37	0,00	-	17.444.000	94,159900	29/12/20	-	-	107,49	-	139.114.637	5,23	4,85
	HAZİNE	13/05/47	US900123CM05	0,00	-	16.850.000	86,756900	29/12/20	-	-	96,38	-	120.485.778	4,53	4,20
ARA GRUP TOPLAMI						280.192.000							2.332.538.193	87,68	81,33

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
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 Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Aış Fiyatı	Satın Aış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
EUROBOND YABANCI	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	04/05/21	XS1403416222	2,69	-	500.000	100,63	08/09/20	-	-	101,47	-	4.625.383	0,17	0,16
	T.İŞ BANKASI A.S.	25/06/21	XS1079527211	4,51	-	390.000	102,71	23/12/20	-	-	100,84	-	2.917.967	0,11	0,10
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	27/10/21	XS1508914691	5,13	-	780.000	101,02	14/12/20	-	-	102,07	-	5.907.174	0,22	0,21
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	24/02/22	XS1571399754	6,27	-	2.040.000	100,64	13/11/20	-	-	103,55	-	15.673.570	0,59	0,55
	T.İŞ BANKASI A.S.	21/04/22	XS1508390090	5,08	-	5.030.000	99,88	22/12/20	-	-	102,56	-	38.274.739	1,44	1,33
	TC ZİRAAT BANKASI	03/05/22	XS1605397394	5,25	-	4.955.000	99,46	23/12/20	-	-	101,52	-	37.320.530	1,40	1,30
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/05/22	XS1622626379	5,75	-	6.370.000	101,17	25/11/20	-	-	101,62	-	48.027.405	1,81	1,67
	TSKB	16/01/23	XS1750996206	5,83	-	3.310.000	100,61	14/12/20	-	-	102,97	-	25.287.789	0,95	0,88
	VAKFN	30/01/23	XS1760780731	5,71	-	2.600.000	100,91	18/12/20	-	-	103,42	-	19.950.134	0,75	0,70
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	16/03/23	XS1788516679	5,29	-	3.430.000	101,50	23/12/20	-	-	104,22	-	26.523.539	1,00	0,92
	TC ZİRAAT BANKASI	29/09/23	XS1691349010	5,42	-	1.580.000	97,09	23/12/20	-	-	101,50	-	11.898.398	0,45	0,41
	EXIMBANK	24/10/23	XS1496463297	7,49	-	500.000	94,68	10/11/20	-	-	102,00	-	3.784.016	0,14	0,13
	EXIMBANK	24/01/24	XS1917720911	7,53	-	1.450.000	103,89	16/10/20	-	-	112,00	-	12.048.826	0,45	0,42
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	28/03/24	XS1970705528	6,33	-	1.390.000	106,13	10/12/20	-	-	109,18	-	11.259.645	0,42	0,39
	T.İŞ BANKASI A.S.	25/04/24	XS1578203462	6,13	-	1.325.000	100,60	03/12/20	-	-	103,17	-	10.142.673	0,38	0,35
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	21/06/24	XS1634372954	6,56	-	2.419.000	98,28	21/12/20	-	-	102,20	-	18.343.182	0,69	0,64
	AKBANK T.A.S.	06/02/26	XS2131335270	6,90	-	3.125.000	100,04	08/07/20	-	-	109,25	-	25.329.901	0,95	0,88
ARA GRUP TOPLAMI						41.194.000							317.314.873	11,93	11,06
ÖZEL SEKTÖR															
Finansman Bonosu	AKBANK T.A.S.	20/01/21	TRFAKBK12148	96,09	-	5.350.000	96,08	04/11/20	-	-	16,56		5.307.486	38,21	0,19
	AKBANK T.A.S.	02/02/21	TRFAKBK22139	96,68	-	1.950.000	96,50	15/10/20	-	-	15,95		1.924.863	13,86	0,07
ARA GRUP TOPLAMI						7.300.000							7.232.349	52,07	0,25
Özel Sektör Tahvil	ENERJISA ELEKTRİK	23/02/21	TRSENJ22110	100,44	-	1.500.000	162,44	15/10/20			169,43		2.541.500	18,30	0,09
	ARCLK	16/07/21	TRSARCL72112	100,02	-	4.000.000	101,50	16/11/20			102,91		4.116.450	29,64	0,14
ARA GRUP TOPLAMI						5.500.000							6.657.950	47,93	0,23
GRUP TOPLAMI						12.800.000							13.890.299	100,00	0,48

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
İleri Valörlü Alışlar Yabancı															
Eurobond Türk	HAZİNE	25/03/27	US900123CL22	-	-	1.300.000	107,95	04/01/21	-	-	107,93	-	10.409.845	0,39	0,36
ARA GRUP TOPLAMI						1.300.000							10.409.845	0,39	0,36
GRUP TOPLAMI						322.686.000							2.660.262.911	100,00	92,76
T.REPO	HAZİNE	04/01/21	TRT060121T16	18,00	-	20.039.452	18,00	31/12/20	-	7.609.270,00	18,00	-	20.009.856	35,71	0,70
	HAZİNE	04/01/21	TRT060121T16	18,00	-	16.031.562	18,00	31/12/20	-	6.087.420,00	18,00	-	16.007.885	28,57	0,56
	HAZİNE	04/01/21	TRT070727T13	18,00	-	10.019.726	18,00	31/12/20	-	6.096.950,00	18,00	-	10.004.928	17,86	0,35
	HAZİNE	04/01/21	TRT070727T13	18,00	-	10.019.726	18,00	31/12/20	-	6.096.950,00	18,00	-	10.004.928	17,86	0,35
GRUP TOPLAMI						56.110.466							56.027.596	100,00	1,95
MEVDUAT	AKBANK T.A.S.	04/01/21	USD	0,15	-	1.452.000	-	31/12/20	-	-	0,15	-	10.773.013	10,36	0,38
	AKBANK T.A.S.	04/01/21	EUR	0,05	-	6.302.000	-	31/12/20	-	-	0,05	-	57.451.631	55,25	2,00
	AKBANK T.A.S.	04/01/21	TL	17,25	-	33.700.000	-	31/12/20	-	-	17,25	-	33.716.046	32,42	1,18
	DENİZ BANK A.Ş.	04/01/21	TL	16,25	-	2.049.730	-	31/12/20	-	-	16,25	-	2.050.649	1,97	0,07
GRUP TOPLAMI						43.503.730							103.991.339	100,00	3,63
TÜREV															
Futures Uzun	-	-	F_EURUSD0121	-	-	900	1,23	22/12/20	-	-	1,23	-	8.202.592	-	-
	-	-	F_EURUSD0221	-	-	13.202	1,23	30/12/20	-	-	1,23	-	120.420.860	-	-

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kaymet	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 (%)
Kısa	-	-	F_USDTRY0121	-	-	13.900	7,43	31/12/20	-		7,51	-	104.354.250	-	-
	-	-	F_USDTRY0221	-	-	13.100	7,51	28/12/20			7,58	-	99.346.470	-	-
GRUP TOPLAMI						41.102							332.324.171	-	-
VIOP NAKİT TEMİNATI	-	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	33.350.361	-	-	-	-	-	-	33.350.361	100,00	1,16
GRUP TOPLAMI						33.350.361							33.350.361	100,00	1,16
DİĞER															
Döviz	EU	-	EUR	-	-	629	9,01	31/12/20	-	-	9,12	-	5.730	-	-
	FED	-	USD	-	-	694	7,34	31/12/20	-	-	7,42	-	5.150	-	-
GRUP TOPLAMI						1.323							10.880	-	-
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	05/02/21	TRD050221F10	100,76	-	40.000	102,08	24/07/19	2,42	-	101,22	-	369.097	100,00	0,01
GRUP TOPLAMI						40.000							369.097	100,00	0,01
FON PORTFÖY DEĞERİ						468.490.557							2.867.891.603		100,00

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KARMA 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	2.867.891.603	-	100,74
(MIZANDAN PORTFOY DEGERI	-	-	-
B,HAZIR DEGERLER	15.923	-	-
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	5.044	31,67	-
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	10.880	68,33	-
C,ALACAKLAR	1.824.560	-	0,06
a)Takastan Alacaklar	-	-	-
i) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
iii) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	1.824.560	100,00	0,06
D,DİGER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(22.988.736)	-	(0,81)
a)Takasa Borçlar	(10.430.680)	45,37	(0,37)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) Yönetim Ücreti	(4.642.701)	20,20	(0,16)
iv) İhbarlı FonPay Takas	(7.807.565)	33,96	(0,27)
v) İleri Valörlü Takas Borçları	(10.430.680)	100,00	(0,37)
b) Odenecek Vergi	-	-	-
c) İhtiyatlar	-	-	-
d) Krediler	-	-	-
e) Diğer Borçlar	(22.362)	0,47	-
i) Denetim Ücreti	(15.851)	0,15	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(6.511)	41,07	-
ı)Kayda Alma Ücreti	(85.428)	0,37	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	2.846.743.351		100,00