

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
ORTA VADELİ 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. 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 ("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. 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, 26 Nisan 2021

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

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-3
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	4

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
ORTA VADELİ 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 Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oran	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk	SAHOL	-	SAHOL	-	-	1	9,46	09/10/19	-	-	11,460000	-	11	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1							11	100,00	0,00
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili	HAZİNE	17/02/21	TRT170221T12	0,00	-	1.585.000	100,36	17/12/20	15,07	-	103,462793	-	1.639.885	2,46	1,10
	HAZİNE	21/04/21	TRT210421T14	102,60	-	1.000.000	109,48	17/12/20	15,49	-	105,758713	-	1.057.587	1,59	0,71
	HAZİNE	22/09/21	TRT220921T18	0,00	-	5.000.000	101,86	18/09/20	16,44	-	98,142914	-	4.907.146	7,37	3,31
	HAZİNE	02/03/22	TRT020322T17	0,00	-	7.500.000	94,89	03/07/20	15,69	-	99,391680	-	7.454.376	11,19	5,02
	HAZİNE	04/05/22	TRT040522T13	93,15	-	1.000.000	94,56	31/12/20	15,13	-	94,609031	-	946.090	1,42	0,64
	HAZİNE	14/09/22	TRT140922T17	92,00	-	1.500.000	95,23	30/10/20	14,83	-	93,985595	-	1.409.784	2,12	0,95
	HAZİNE	09/11/22	TRT091122T10	0,00	-	2.000.000	101,07	30/12/20	15,00	-	101,047691	-	2.020.954	3,03	1,36
	HAZİNE	18/01/23	TRT180123T10	0,00	-	1.000.000	102,30	30/12/20	14,42	-	102,500834	-	1.025.008	1,54	0,69
	HAZİNE	08/03/23	TRT080323T10	93,93	-	500.000	90,40	03/11/20	14,37	-	89,820049	-	449.100	0,67	0,30
	HAZİNE	14/06/23	TRT140623T19	0,00	-	1.200.000	113,48	23/06/20	14,44	-	105,306916	-	1.263.683	1,90	0,85
	HAZİNE	27/09/23	TRT270923T11	87,35	-	2.000.000	93,15	14/10/20	14,24	-	91,257275	-	1.825.146	2,74	1,23
	HAZİNE	18/10/23	TRT181023T19	16,95	-	105.984	111,39	30/04/19	13,86	-	119,213375	-	126.347	0,19	0,09
	HAZİNE	20/03/24	TRT200324T13	0,00	-	2.000.000	101,53	12/06/20	13,91	-	95,112925	-	1.902.259	2,86	1,28
	HAZİNE	24/07/24	TRT240724T15	0,00	-	6.000.000	93,88	11/12/20	13,49	-	92,614111	-	5.556.847	8,34	3,74
	HAZİNE	12/03/25	TRT120325T12	79,60	-	5.000.000	83,97	03/11/20	13,37	-	86,759820	-	4.337.991	6,51	2,92
	HAZİNE	01/10/25	TRT011025T16	99,40	-	1.500.000	102,40	31/12/20	13,20	-	102,382782	-	1.535.742	2,31	1,03
	HAZİNE	11/02/26	TRT110226T13	87,55	-	17.550.000	91,69	30/12/20	12,85	-	97,138146	-	17.047.745	25,60	11,49
	HAZİNE	11/08/27	TRT110827T16	93,80	-	12.700.000	95,11	30/11/20	12,90	-	95,146619	-	12.083.621	18,15	8,14
ARA GRUP TOPLAMI						69.140.984							66.589.309	100,00	44,87

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
ORTA VADELİ 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 (%)
Özel Sektör															
Finansman Bonosu	AKBANK T.A.S.	29/01/21	TRSAKBK12117	16,50	-	200.000	82,23	09/04/20	16,12	-	98,860119	-	197.720	0,38	0,13
	VAKIF FAKTORİNG A.Ş.	01/02/21	TRFVFAS22114	16,00	-	6.000.000	96,61	13/11/20	17,03	-	98,673275	-	5.920.396	11,49	3,99
	İŞ FAKTORİNG	11/02/21	TRFISFA22111	15,75	-	5.000.000	96,26	13/11/20	16,71	-	98,279464	-	4.913.973	9,53	3,31
	FINANSBANK A.S.	16/02/21	TRFFFKR22126	16,00	-	5.000.000	96,16	17/11/20	16,98	-	98,042747	-	4.902.137	9,51	3,30
	AKBANK T.A.S.	18/02/21	TRFAKBK22170	2,00	-	2.000.000	100,00	04/12/20	0,00	-	101,288000	-	2.025.760	3,93	1,36
	HSBC BANK A.S.	05/05/21	TRFHBCS22115	15,00	-	4.470.000	92,06	07/10/20	19,42	-	94,147775	-	4.208.406	8,17	2,84
ARA GRUP TOPLAMI						22.670.000							22.168.393	43,01	14,94
Özel Sektör Tahvil															
Özel Sektör Tahvil	ARCLK	12/02/21	TRSAARCL22117	100,27	-	10.000.000	101,86	17/12/20	15,97	-	102,481448	-	10.248.145	19,89	6,90
	CİMSA	18/03/21	TRSCMSA32112	100,00	-	6.320.000	100,00	17/12/20	18,41	-	100,699711	-	6.364.222	12,35	4,29
	AKBANK T.A.S.	08/04/21	TRSAKBK42114	95,04	-	5.070.000	95,04	17/12/20	19,76	-	95,321997	-	4.832.825	9,38	3,26
	KOÇ TÜKETİCİ FİNANSMANI	14/07/21	TRSKCTF72127	100,00	-	6.720.000	102,59	17/12/20	16,68	-	102,704122	-	6.901.717	13,39	4,65
	T.İŞ BANKASI A.S.	07/02/22	TRSTİSB22212	8,00	-	1.000.000	100,00	10/02/20	0,00	-	102,176000	-	1.021.760	1,98	0,69
ARA GRUP TOPLAMI						29.110.000							29.368.669	56,99	19,79
GRUP TOPLAMI						51.780.000							51.537.062	100,00	34,72
İleri Valörlü Alışlar Türk Devlet Tahvili															
Devlet Tahvili	HAZİNE	22/09/21	TRT220921T18	0,00	-	2.000.000	98,30	04/01/21	-	-	98,342000	-	1.966.840	100,00	1,33
ARA GRUP TOPLAMI						2.000.000							1.966.840	100,00	1,33
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	TKYB VARLIK FİNANSMAN FONU	07/12/23	TRPKYVFA2318	16,99	-	1.000.000	100,00	07/12/18	12,78	-	112,791508	-	1.127.915	100,00	0,76
ARA GRUP TOPLAMI						1.000.000							1.127.915	100,00	0,76
GRUP TOPLAM						123.920.985							121.221.138		81,68

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
ORTA VADELİ 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 (%)
T.REPO	HAZİNE	04/01/21	TRT070727T13	17,90	-	12.023.540	17,900000	31/12/20		7.316.265,00	17,900000	-	12.005.881	85,71	8,09
	HAZİNE	04/01/21	TRT261022T10	17,91	-	2.003.925	17,910000	31/12/20		863.635,00	17,910000	-	2.000.981	14,29	1,35
GRUP TOPLAMI						14.027.465							14.006.861	100,00	9,44
MEVDUAT	AKBANK T.A.S.	04/01/21	-	17,25	-	5.004.714	-	31/12/20	-	-	17,250000	-	5.007.071	100,00	3,37
GRUP TOPLAMI						5.004.714							5.007.071	100,00	3,37
TPP															
	-	04/01/21	-	17,85	-	1.533.995	17,85	31/12/20	-	-	17,850000	-	1.531.748	26,20	1,03
	-	04/01/21	-	17,85	-	2.533.947	17,85	31/12/20	-	-	17,850000	-	2.530.236	43,27	1,70
	-	18/01/21	-	16,80	-	1.284.521	16,80	19/11/20	-	-	18,000000	-	1.273.846	21,79	0,86
	-	11/05/21	-	17,25	-	542.534	17,25	12/11/20	-	-	17,25	-	511.462	8,75	0,34
GRUP TOPLAMI						5.894.997							5.847.293	100,00	3,94
VIOP Nakit Teminatı	-	-	-	-	-	2.336.349	-	-	-	-	-	-	2.336.349	100,00	1,57
GRUP TOPLAMI						2.336.349							2.336.349	100,00	1,57
FON PORTFÖY DEĞERİ						151.184.511							148.418.712		100,00
TÜREV															
Futures															
Kısa	-	-	F_USDTRY0221	-	-	300	7,58	31/12/20	-	-	7,583700	-	2.275.110	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						300							2.275.110	0,00	0,00

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ

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

	31 Aralık 2020		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	148.418.712	-	101,38
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	-	-	-
B,HAZIR DEĞERLER	20.713	-	0,01
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	20.713	100,00	0,01
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	171.314	-	0,12
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	171.314	100,00	0,12
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(2.213.709)	-	(1,51)
a)Takasa Borçlar	(1.966.086)	88,81	(1,34)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii)İleri Valörlü Takas	(1.966.086)	88,81	(1,34)
b) Yönetim Ücreti	(236.106)	10,67	(0,16)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Krediler	-	-	-
f) Diğer Borçlar	(7.121)	0,52	-
i) Denetim Ücreti	(5.035)	0,23	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(2.086)	0,09	-
ı)Kayda Alma Ücreti	(4.396)	0,20	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	146.397.029		100,00