

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN 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.
OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN 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. OKS Muhafazakar Değişken 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. OKS Muhafazakar Değişken 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

**AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN 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. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN 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 Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili	HAZİNE	14/04/21	TRT140421T13	0,00	-	1.000.000	95,92	31/12/20	15,60	-	95,992114	-	959.921	15,69	10,36
	HAZİNE	21/04/21	TRT210421T14	101,85	-	120.000	104,66	09/12/20	15,49	-	105,758713	-	126.910	2,07	1,37
	HAZİNE	22/09/21	TRT220921T18	95,48	-	30.000	97,50	11/12/20	16,44	-	98,142914	-	29.443	0,48	0,32
	HAZİNE	26/01/22	TRT260122T11	100,27	-	300.000	102,87	29/12/20	17,31	-	103,002049	-	309.006	5,05	3,33
ARA GRUP TOPLAMI						1.450.000							1.425.281	23,29	15,38
Özel Sektör															
Finansman Bonosu	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	08/01/21	TRFYKKBK12155	8,00	-	420.000	100,00	20/10/20	0,00	-	101,455000	-	426.111	6,96	4,60
	GARFA	14/01/21	TRFGRFA12134	97,30	-	150.000	96,95	30/11/20	15,09	-	99,500699	-	149.251	2,44	1,61
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	21/01/21	TRFVKFB12169	12,00	-	200.000	100,00	20/10/20	0,00	-	100,515000	-	201.030	3,29	2,17
	İŞ LEASING	27/01/21	TRFISFN12123	97,11	-	450.000	96,56	06/11/20	13,92	-	99,075663	-	445.840	7,29	4,81
	AKBANK T.A.Ş.	29/01/21	TRSAKBK12117	16,50	-	300.000	82,23	09/10/19	16,12	-	98,860119	-	296.580	4,85	3,20
	VAKIF FAKTORİNG A.Ş.	01/02/21	TRFVFAS22114	16,00	-	350.000	96,61	13/11/20	17,03	-	98,673275	-	345.356	5,64	3,73
	FINANSBANK A.Ş.	05/02/21	TRFFNBK22116	12,00	-	650.000	100,00	29/12/20	0,00	-	101,567000	-	660.186	10,79	7,12
	T.EKONOMİ BANKASI A.Ş.	10/02/21	TRFTBTF22114	16,15	-	240.000	96,13	11/11/20	17,16	-	98,279623	-	235.871	3,85	2,55
	İŞ FAKTORİNG	11/02/21	TRFISFA22111	15,75	-	350.000	96,26	13/11/20	16,71	-	98,279464	-	343.978	5,62	3,71
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	01/03/21	TRFGRAN32128	100,24	-	740.000	100,58	07/10/20	0,00	-	100,005000	-	740.037	12,09	7,99
	HSBC BANK A.Ş.	05/05/21	TRFHBC52115	93,07	-	420.000	92,54	04/11/20	19,42	-	94,147775	-	395.421	6,46	4,27
	MERCEDES - BENZ FİNANSAL HİZMETLER	01/12/21	TRFMCBFA2110	85,83	-	60.000	85,83	11/12/20	17,00	-	86,614768	-	51.968,86	0,85	0,56
ARA GRUP TOPLAMI						4.330.000							4.291.630,59	70,14	46,31
Özel Sektör Tahvil	MİGROS TİCARET A.Ş.	08/06/22	TRSMGTİ62228	10,12	-	60.000	100,00	10/06/20	15,33	-	100,908412	-	60.545	0,99	0,65
	TUPRS	28/11/22	TRSTPRSK2217	12,00	-	250.000	100,00	30/11/20	0,00	-	101,429000	-	253.573	4,14	2,74
ARA GRUP TOPLAMI						4.640.000							4.605.748	5,13	3,39
GRUP TOPLAMI						8.970.000							8.897.379	75,27	49,70

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN 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 Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutarı	Birim Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
Varlığa Dayalı Menkul Kıyım	AKTİFBANK	26/02/21	TRPAV1222119	96,76	-	90.000	96,76	21/12/20	19,64	-	97,286636	-	87.558	1,43	0,94
ARA GRUP TOPLAMI						90.000							87.558	1,43	0,94
GRUP TOPLAMI						6.180.000							6.118.587	100,00	66,02
MEVDUAT	T.İŞ BANKASI A.Ş.	04/01/21	-	16,25	-	400.000	-	01/12/20	-	-	16,250000	-	405.502	18,88	4,38
	AKBANK T.A.Ş.	04/01/21	-	17,25	-	140.442	-	31/12/20	-	-	17,250000	-	140.509	6,54	1,52
	AKBANK T.A.Ş.	06/01/21	-	16,90	-	200.000	-	04/12/20	-	-	16,900000	-	202.583	9,43	2,19
	TC ZIRAAT BANKASI	13/01/21	-	16,75	-	127.409	-	11/12/20	-	-	16,750000	-	128.630	5,99	1,39
	T.EKONOMİ BANKASI A.Ş.	15/01/21	-	17,20	-	441.239	-	14/12/20	-	-	17,200000	-	444.959	20,72	4,80
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	25/01/21	-	17,50	-	170.983	-	21/12/20	-	-	17,500000	-	171.883	8,00	1,85
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	26/01/21	-	18,00	-	159.879	-	25/12/20	-	-	18,000000	-	160.432	7,47	1,73
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	01/02/21	-	18,00	-	101.639	-	28/12/20	-	-	18,000000	-	101.838	4,74	1,10
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	01/02/21	-	18,50	-	238.014	-	29/12/20	-	-	18,500000	-	238.372	11,10	2,57
	AKBANK T.A.Ş.	05/02/21	-	18,25	-	152.223	-	28/12/20	-	-	18,250000	-	152.524	7,10	1,65
GRUP TOPLAMI						2.131.828							2.147.230	100,00	23,17
TPP		04/01/21	-	17,85	-	228.446	17,850000	31/12/20	-	-	17,850000	-	228.111	27,94	2,46
		05/01/21	-	17,50	-	72.380	17,500000	25/12/20	-	-	18,150000	-	72.236	8,85	0,78
		05/01/21	-	17,80	-	50.195	17,800000	28/12/20	-	-	18,150000	-	50.095	6,14	0,54
		06/01/21	-	18,00	-	50.222	18,000000	28/12/20	-	-	18,300000	-	50.096	6,14	0,54
		08/01/21	-	18,00	-	30.148	18,000000	29/12/20	-	-	18,290000	-	30.043	3,68	0,32
		13/01/21	-	17,00	-	30.559	17,000000	04/12/20	-	-	18,000000	-	30.379	3,72	0,33
		15/01/21	-	17,00	-	35.717	17,000000	02/12/20	-	-	18,000000	-	35.473	4,34	0,38
		10/02/21	-	16,50	-	26.017	16,500000	12/11/20	-	-	16,740000	-	25.554	3,13	0,28
		10/02/21	-	16,60	-	52.047	16,600000	12/11/20	-	-	16,740000	-	51.119	6,26	0,55
		18/02/21	-	16,90	-	20.833	16,900000	20/11/20	-	-	16,900000	-	20.385	2,50	0,22
		05/03/21	-	13,75	-	53.334	13,750000	09/09/20	-	-	13,750000	-	52.123	6,38	0,56

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN 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	(%)	(%)
		08/03/21	-	13,50	-	53.347	13,50	08/09/20	-	-	17,500000	-	51.720	6,33	0,56
		09/03/21	-	13,75	-	42.712	13,75	10/09/20	-	-	17,630000	-	41.380	5,07	0,45
		12/03/21	-	13,50	-	53.273	13,50	16/09/20	-	-	13,500000	-	51.954	6,36	0,56
		16/03/21	-	13,85	-	26.708	13,85	17/09/20	-	-	18,100000	-	25.766	3,16	0,28
GRUP TOPLAMI						825.938							816.434	100,00	8,81
VIOP Nakit Teminatı	-	-	-	-	-	185.342	-	-	-	-	-	-	185.342	100,00	2,00
GRUP TOPLAMI						185.342							185.342	100,00	2,00
FON PORTFÖY DEĞERİ						9.323.109							9.267.593		100,00
TÜREV															
Futures															
Uzun	-	-	F_XU0300221	-	-	15	1.658,50	31/12/20	-	-	1.658,500000	-	248.775	0,00	0,00
Kısa	-	-	F_USDTRY0221	-	-	18	7,583700	31/12/20	-	-	7,583700	-	136.507	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						33							385.282	0,00	0,00

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN 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	9.267.593	-	100,20
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	-	-	-
B,HAZIR DEĞERLER	5.111	-	0,06
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	5.111	100,00	0,06
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(23.999)	-	(0,26)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(6.818)	28,41	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(16.903)	71,59	(0,18)
i) Denetim Ücreti	(4.125)	17,19	(0,04)
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(12.778)	53,24	(0,14)
ı)Kayda Alma Ücreti	(278)	1,16	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	9.248.705		100,00