

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DİNAMİK KATILIM 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 DİNAMİK KATILIM 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 Dinamik Katılım 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 Dinamik Katılım 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

**AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK KATILIM DEĞİŞKEN
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

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

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK KATILIM 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				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Ahş	Ahş	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk	AKCNS	-	AKCNS	-	-	1.423	16,73	31/12/20	-	-	16,540000	-	23.536	0,71	0,26
	ALBARAKA TURK KATILIM BANKASI A.S.	-	ALBRK	-	-	17.000	1,77	11/11/20	-	-	1,940000	-	32.980	1,00	0,37
	ALBARAKA TURK KATILIM BANKASI A.S.	-	ALBRK	-	-	(857)	1,77	31/12/20	-	-	1,940000	-	(1.663)	(0,05)	(0,02)
	ALKIM	-	ALKIM	-	-	7.870	13,21	05/10/20	-	-	14,900000	-	117.256	3,54	1,32
	ALKIM	-	ALKIM	-	-	(411)	13,21	31/12/20	-	-	14,900000	-	(6.124)	(0,18)	(0,07)
	ASELS	-	ASELS	-	-	12.690	15,08	15/12/20	-	-	18,250000	-	231.593	7,00	2,60
	ASELS	-	ASELS	-	-	4.098	19,26	31/12/20	-	-	18,250000	-	74.789	2,26	0,84
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	5.794	64,09	31/12/20	-	-	75,500000	-	437.447	13,21	4,92
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	(295)	64,09	31/12/20	-	-	75,500000	-	(22.273)	(0,67)	(0,25)
	BLCYT	-	BLCYT	-	-	1	5,24	05/10/20	-	-	6,640000	-	3	0,00	0,00
	CEMTS	-	CEMTS	-	-	3.700	14,27	28/12/20	-	-	15,940000	-	58.978	1,78	0,66
	CEMTS	-	CEMTS	-	-	(195)	14,27	31/12/20	-	-	15,940000	-	(3.108)	(0,09)	(0,03)
	ECILC	-	ECILC	-	-	12.720	6,94	28/12/20	-	-	7,460000	-	94.891	2,87	1,07
	ECILC	-	ECILC	-	-	(656)	6,94	31/12/20	-	-	7,460000	-	(4.894)	(0,15)	(0,06)
	EGEEN	-	EGEEN	-	-	41	713,34	02/11/20	-	-	1.770,100000	-	72.574	2,19	0,82
	EGEEN	-	EGEEN	-	-	(2)	713,34	31/12/20	-	-	1.770,100000	-	(3.540)	(0,11)	(0,04)
	EGGUB	-	EGGUB	-	-	590	129,34	25/12/20	-	-	145,200000	-	85.668	2,59	0,96
	EGGUB	-	EGGUB	-	-	(220)	129,34	31/12/20	-	-	145,200000	-	(31.944)	(0,96)	(0,36)
	ERBOS	-	ERBOS	-	-	1	16,44	03/07/19	-	-	41,000000	-	39	0,00	0,00
	EREGL	-	EREGL	-	-	37.973	10,45	24/12/20	-	-	14,930000	-	566.937	17,12	6,37
	EREGL	-	EREGL	-	-	(1.926)	10,45	31/12/20	-	-	14,930000	-	(28.755)	(0,87)	(0,32)
	GENTS	-	GENTS	-	-	0	2,08	05/10/20	-	-	5,940000	-	1	0,00	0,00
	INDES	-	INDES	-	-	6.940	17,04	31/12/20	-	-	19,130000	-	132.762	4,01	1,49
	INDES	-	INDES	-	-	(2.168)	17,04	31/12/20	-	-	19,130000	-	(41.474)	(1,25)	(0,47)
	ISKENDERUN DEMİR ÇELİK	-	ISDMR	-	-	18.860	8,76	31/12/20	-	-	10,110000	-	190.675	5,76	2,14
	ISKENDERUN DEMİR ÇELİK	-	ISDMR	-	-	(962)	8,76	31/12/20	-	-	10,110000	-	(9.726)	(0,29)	(0,11)
	LOGO	-	LOGO	-	-	1.310	86,32	28/12/20	-	-	125,500000	-	164.405	4,97	1,85
	LOGO	-	LOGO	-	-	(68)	86,32	31/12/20	-	-	125,500000	-	(8.534)	(0,26)	(0,10)
	MAVI JEANS	-	MAVI	-	-	3.429	46,17	28/12/20	-	-	52,200000	-	178.994	5,41	2,01
	MAVI JEANS	-	MAVI	-	-	(175)	46,17	31/12/20	-	-	52,200000	-	(9.135)	(0,28)	(0,10)

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK KATILIM 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	(%)	(%)
	OYAK BANK A.Ş.	-	OYAKC	-	-	12.100	8,27	24/12/20	-	-	8,780000	-	106.238	3,21	1,19
	OYAK BANK A.Ş.	-	OYAKC	-	-	(622)	8,27	31/12/20	-	-	8,780000	-	(5.461)	(0,16)	(0,06)
	PGSUS	-	PGSUS	-	-	2.100	55,88	09/12/20	-	-	74,600000	-	156.660	4,73	1,76
	PGSUS	-	PGSUS	-	-	(108)	55,88	31/12/20	-	-	74,600000	-	(8.057)	(0,24)	(0,09)
	SASA	-	SASA	-	-	0	7,11	03/10/19	-	-	20,220000	-	7	0,00	0,00
	SELEC	-	SELEC	-	-	1.000	14,36	30/12/20	-	-	13,650000	-	13.650	0,41	0,15
	TATGD	-	TATGD	-	-	4.430	11,42	19/11/20	-	-	11,860000	-	52.540	1,59	0,59
	TATGD	-	TATGD	-	-	1.667	11,80	31/12/20	-	-	11,860000	-	19.771	0,60	0,22
	THYAO	-	THYAO	-	-	26.700	10,75	09/12/20	-	-	12,910000	-	344.697	10,41	3,87
	THYAO	-	THYAO	-	-	(1.374)	10,75	31/12/20	-	-	12,910000	-	(17.738)	(0,54)	(0,20)
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	TKFEN	-	-	9.830	15,16	31/12/20	-	-	16,590000	-	163.080	4,93	1,83
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	TKFEN	-	-	(506)	15,16	31/12/20	-	-	16,590000	-	(8.395)	(0,25)	(0,09)
	TUKAS	-	TUKAS	-	-	4.000	9,85	28/12/20	-	-	9,690000	-	38.760	1,17	0,44
	TUKAS	-	TUKAS	-	-	(204)	9,85	31/12/20	-	-	9,690000	-	(1.977)	(0,06)	(0,02)
	YATAS	-	YATAS	-	-	12.020	10,08	31/12/20	-	-	14,450000	-	173.689	5,25	1,95
	YATAS	-	YATAS	-	-	(625)	10,08	31/12/20	-	-	14,450000	-	(9.031)	(0,27)	(0,10)
GRUP TOPLAM						196.912							3.310.790	100,00	37,22
DİĞER															
Y.Fonu Türk	ZİRAAT PORTFÖY	-	TCA-ZİRAAT PORTFÖY ALTIN KATILIM FONU	-	-	1.703.000	0,050490	20/04/20	-	-	0,058650	-	99.881	100,00	1,12
GRUP TOPLAMI						1.703.000							99.881	100,00	1,12

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK KATILIM 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
Kayıt	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Kur	Deger	(%)	(%)
Kontrat Sayısı				Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutarı	Deger				
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
	HAZİNE	10/02/21	TRD100221T17	100,48	-	970.000	106,55	30/12/20	14,44	-	107,203607	-	1.039.875	18,96	11,69
	HAZİNE	16/06/21	TRD160621T17	103,08	-	80.000	112,18	23/12/20	14,84	-	103,807353	-	83.046	1,51	0,93
	HAZİNE	14/07/21	TRD140721T18	99,85	-	240.000	101,19	20/11/20	14,80	-	101,972562	-	244.734	4,46	2,75
	HAZİNE	18/08/21	TRD180821T13	102,00	-	370.000	107,84	02/10/20	15,04	-	105,628545	-	390.826	7,13	4,39
	HAZİNE	15/12/21	TRD151221T10	99,00	-	810.000	104,02	18/11/20	14,04	-	98,714535	-	799.588	14,58	8,99
	HAZİNE	26/01/22	TRD260122T19	98,70	-	370.000	100,15	06/10/20	13,71	-	100,791479	-	372.928	6,80	4,19
	HAZİNE	10/08/22	TRD100822T10	94,58	-	50.000	96,68	07/02/20	14,79	-	99,305525	-	49.653	0,91	0,56
ARA GRUP TOPLAMI						2.890.000							2.980.650	54,34	33,51
Özel Sektör Kira Sertifikaları															
	ZİRAAT KATILIM VK	06/01/21	TRDZKVK12114	99,96	-	600.000	102,40	31/12/20	13,21	-	103,296106	-	619.777	11,30	6,97
	ZİRAAT KATILIM VK	26/01/21	TRDZKVK12122	99,99	-	40.000	101,27	19/11/20	16,47	-	102,626860	-	41.051	0,75	0,46
	ZİRAAT KATILIM VK	24/02/21	TRDZKVK22139	99,55	-	80.000	100,22	28/12/20	18,18	-	101,461423	-	81.169	1,48	0,91
	EMLAK KATILIM BANKASI	26/02/21	TRDEVKS22160	99,88	-	260.000	100,88	18/12/20	17,22	-	101,424453	-	263.704	4,81	2,96
	VAKIF KATILIM	03/03/21	TRDVVRK32124	4,03	-	500.000	100,00	25/11/20	16,42	-	101,417452	-	507.087	9,24	5,70
	ZİRAAT KATILIM VK	11/03/21	TRDZKVK32112	4,50	-	580.000	100,00	04/12/20	17,88	-	101,304472	-	587.566	10,71	6,60
	VAKIF KATILIM	25/03/21	TRDVVRK32132	4,86	-	400.000	100,00	09/12/20	17,77	-	101,035949	-	404.144	7,37	4,54
ARA GRUP TOPLAMI						2.460.000							2.504.497	45,66	28,15
GRUP TOPLAMI						5.350.000							5.485.147	100,00	61,66
FON PORTFÖY DEĞERİ						7.249.912							8.895.818		100,00
DÖVİZ															
	EU	-	EUR	-	-	0	6,59	31/12/20	-	-	9,116400	-	3	0,00	0,00
	FED	-	USD	-	-	7.529	5,99	31/12/20	-	-	7,419400	-	55.860	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						7.529							55.863	0,00	0,00

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK KATILIM 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	8.895.818	-	97,93
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	-	-	-
B,HAZIR DEĞERLER	81.600	-	0,90
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	25.737	31,54	0,28
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	55.863	68,46	0,61
C,ALACAKLAR	324.188	-	3,57
a)Takastan Alacaklar	317.080	97,81	3,49
i) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	102.797	31,71	1,13
iii) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
iv)İleri Valörlü Takas	214.283	66,10	2,36
b) Diğer Alacaklar	6.737	2,08	0,07
i)Temettu	371	0,11	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(217.890)	-	(2,40)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	(156.421)	71,79	(1,72)
c) Yönetim Ücreti	(6.261)	2,87	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(54.935)	25,34	(0,60)
i) Denetim Ücreti	(4.099)	1,88	(0,05)
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(50.836)	23,33	(0,56)
ı)Kayda Alma Ücreti	(273)	0,13	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	9.083.716		100,00