

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
İZAHNAME DEĞİŞİKLİĞİ

"Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu" izahnamesinin 5.5. maddesi altında yer alan 4 numaralı bendi Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 05/12/2018 tarih ve 32507-E.13602 sayılı izin doğrultusunda aşağıdaki şekilde değiştirilmiştir:

ESKİ ŞEKİL

5.5. Değerleme esaslarına ilişkin olarak, Yönetmelik uyarınca fon kurulu kararı ile belirlenen değerleme esasları aşağıdaki gibidir:

4) Yabancı Borçlanma Araçları

Yabancı borçlanma araçlarının değerleme fiyatı, Reuters veri dağıtım ekranlarının TSI 16:15-16:45 arasında alınan ağırlıklı ortalama fiyatlarına, fon fiyatı hesaplanacak gün itibarı ile birikmiş olan kupon faizi de üzerine eklenerek belirlenir. Alış ya da satış kotasyonu bulunmaması durumunda ise değerlemede kullanılacak kirli fiyat, bir önceki günün kirli fiyatının ertesi iş gününe iç verimle iletilemesiyle bulunur. Tam iş günü olmayan günlerde, TSI 12:00 - 12:30 saatleri arasında alınan ağırlıklı ortalama fiyatlar kullanılacaktır.

4) Organize Piyasalarda İşlem Gören Opsiyonlar ve Vadeli İşlem Sözleşmeleri

Yurtdışı borsalardan alınan ve satılan opsiyonlar ve vadeli işlem sözleşmeleri için değerlemede, Bloomberg ekranlarından alınan kapanış fiyatları kullanılacaktır. Değerleme günü borsada işlem geçmemesi halinde Bloomberg ekranındaki alım satım kotasyonlarının ortalaması kullanılır.

YENİ ŞEKİL

5.5. Değerleme esaslarına ilişkin olarak, Yönetmelik uyarınca fon kurulu kararı ile belirlenen değerleme esasları aşağıdaki gibidir:

4.1) Yabancı Borçlanma Araçları

Yabancı Borçlanma Araçları değerlemesinde, Bloomberg ve/veya Reuters veri dağıtım ekranlarından TSI 16:15 - 16:45 arasında alınan alış ve satış fiyat kotasyonlarının ortalamasına (temiz fiyat), fon fiyatı hesaplanacak gün itibarı ile birikmiş olan kupon getirisinin eklenmesi ile hesaplanmış kirli fiyat kullanılır. Bu hesaplama, tam iş günü olmayan günlerde, TSI 12:00 - 12:30 arasında alınan alış ve satış fiyat kotasyonlarının ortalaması (temiz fiyat) kullanılarak yapılır. Alış ya da satış kotasyonu bulunmaması durumunda ise değerlemede kullanılacak kirli fiyat, bir önceki günün kirli fiyatının ertesi iş gününe iç verimle iletilemesiyle bulunur.

4.2) Organize Piyasalarda İşlem Gören Opsiyonlar ve Vadeli İşlem Sözleşmeleri

Yurtdışı borsalardan alınan ve satılan opsiyonlar ve vadeli işlem sözleşmeleri için değerlemede, Bloomberg ekranlarından alınan kapanış fiyatları kullanılacaktır. Değerleme günü borsada işlem geçmemesi halinde Bloomberg ekranındaki alım satım kotasyonlarının ortalaması kullanılır.

AVİVASA
 Emeklilik ve Hayat A.Ş.
 Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş.

