

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

31 ARALIK 2019 İTİBARIYLA
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. 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. 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 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. 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, 21 Nisan 2020

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Net	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Sözleşme No	Teminat Tutarı	Dönüş Tutarı	Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvil																		
TRT150120T16	HAZİNE	15.01.2020			100,00		1.908.000	104,35	30.12.2019	10,58	722652376678743616			104,84		2.000.440	0,07	0,06
TRT050220T17	HAZİNE	5.02.2020			0,00		148.942	101,93	26.12.2019	10,54	0A066482000CEE66			102,71		152.976	0,01	0,01
TRT010420T19	HAZİNE	1.04.2020			0,00		834.757	173,45	3.07.2017	2,81	05836			251,90		2.102.783	0,08	0,07
TRT130520T14	HAZİNE	13.05.2020			96,33		2.830.000	94,85	30.12.2019	10,67	722770849056788119			96,37		2.727.406	0,10	0,09
TRT100620T16	HAZİNE	10.06.2020			95,58		49.100.000	91,41	30.12.2019	11,00	722770849056582664			95,50		46.891.626	1,73	1,53
TRT080720T19	HAZİNE	8.07.2020			99,45		176.700.000	102,50	31.12.2019	10,81	722810706352862956			103,97		183.718.946	6,79	6,01
TRT120820T12	HAZİNE	12.08.2020			107,30		33.720.000	112,39	30.12.2019	10,71	722770849056574353			116,12		39.154.105	1,45	1,28
TRT160920T25	HAZİNE	16.09.2020			0,00		223.820.000	87,69	31.12.2019	11,31	6449C5C2:0168279D			92,68		207.436.817	7,66	6,78
TRT071020T23	HAZİNE	7.10.2020			92,09		227.500.000	89,60	31.12.2019	11,27	722612519382298928			92,13		209.600.210	7,74	6,85
TRT060121T16	HAZİNE	6.01.2021			100,88		340.000	196,17	20.11.2019	2,95	721187827190505216			242,48		824.435	0,03	0,03
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00		271.517.000	101,99	31.12.2019	11,45	6446F542:0127470F			103,46		280.913.426	10,34	9,13
TRT210421T14	HAZİNE	21.04.2021			0,00		99.300.000	111,50	31.12.2019	11,47	6446F542:012B6948			115,54		114.734.568	4,24	3,75
TRT190521T17	HAZİNE	19.05.2021			0,00		200.000	99,29	25.11.2016	16,25	05719			103,99		207.984	0,01	0,01
TRT210721T11	HAZİNE	21.07.2021			100,10		5.210.385	221,87	20.12.2019	2,93	722375299748612913			231,87		12.081.327	0,45	0,39
TRT220921T18	HAZİNE	22.09.2021			0,00		183.285.000	98,05	31.12.2019	11,61	6446F542:0126C0D0			99,28		181.965.127	6,72	5,95
TRT201021T25	HAZİNE	20.10.2021			0,00		123.800.000	103,59	31.12.2019	11,77	64458E42:01493D08			106,41		131.737.364	4,87	4,31
TRT120122T17	HAZİNE	12.01.2022			0,00		49.545.008	93,17	26.12.2019	11,68	6446F542:012C6848			101,14		50.109.621	1,85	1,64
TRT020322T17	HAZİNE	2.03.2022			98,30		32.080.000	99,53	23.12.2019	11,71	722296959545158373			102,90		33.009.429	1,22	1,08
TRT200422T14	HAZİNE	20.04.2022			97,20		28.500.000	101,36	20.12.2018	20,25	7.0128E+17			106,20		30.268.328	1,12	0,99
TRT170822T15	HAZİNE	17.08.2022			0,00		77.850.000	98,07	26.12.2019	11,77	6446F542:012CDBF0			102,31		79.649.253	2,94	2,60
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			0,00		16.734.710	95,26	31.12.2019	11,44	6446F542:01175F4F			96,48		16.146.422	0,60	0,53
TRT261022T10	HAZİNE	26.10.2022			0,00		2.300.000	180,11	18.02.2019	2,99	09DB14420009077D			206,84		4.757.267	0,18	0,16
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		148.595.000	98,50	31.12.2019	11,66	6446F542:012DB80E			107,64		159.943.967	5,91	5,23
TRT080323T10	HAZİNE	8.03.2023			0,00		76.172.076	87,76	26.12.2019	11,92	6446F542:012E113A			90,55		68.976.045	2,55	2,25
TRT140623T19	HAZİNE	14.06.2023			0,00		55.110.000	111,44	25.12.2019	11,70	64458E42:011AB267			114,21		62.939.258	2,32	2,06
TRT020823T11	HAZİNE	2.08.2023			0,00		37.567	99,05	5.12.2013	2,97				200,09		75.167	0,00	0,00
TRT270923T11	HAZİNE	27.09.2023			90,80		6.164.084	87,60	31.12.2019	11,81	722019057981234848			94,28		5.811.550	0,21	0,19
TRT181023T19	HAZİNE	18.10.2023			0,00		950.000	128,09	26.12.2019	11,71	6446F542:012F2DCD			130,24		1.237.247	0,05	0,04
TRT081123T10	HAZİNE	8.11.2023			0,00		3.000.000	186,55	25.12.2019	3,05	64458E42:01085104			194,26		5.827.709	0,22	0,19
TRT200324T13	HAZİNE	20.03.2024			97,00		24.023.809	96,49	31.12.2019	11,86	722810706353298429			99,17		23.825.480	0,88	0,78

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

					Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç		Borsa	Repo	Net	Günlük						
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Faiz	Ödeme		Deger/	Alış	Alış	İskonto		Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam		
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oran	Sayısı		Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı		No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)		
BORÇLANMA SENETLERİ																						
Devlet Tahvili																						
TRT240724T15	HAZİNE	24.07.2024			0,00			129.294.567	90,52	30.12.2019	12,24	6449C5C2:014774D1				93,94		121.455.067	4,49	3,97		
TRT120325T12	HAZİNE	12.03.2025			84,90			7.246.000	84,64	11.12.2019	12,14	721939618266102421				87,94		6.372.465	0,24	0,21		
TRT140126T11	HAZİNE	14.01.2026			96,20			100.000	125,38	17.07.2018	3,10	701752584779790800				160,81		160.809	0,01	0,01		
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			94,18			158.680.000	96,56	31.12.2019	12,38	722810706352806340				97,95		155.424.398	5,74	5,08		
TRT240227T17	HAZİNE	24.02.2027			95,65			124.240.000	94,66	31.12.2019	12,37	722573211841604633				98,94		122.928.789	4,54	4,02		
TRT070727T13	HAZİNE	7.07.2027			94,67			1.900.000	124,81	10.12.2019	3,13	721187827190510161				140,48		2.669.174	0,10	0,09		
TRT110827T16	HAZİNE	11.08.2027			93,00			69.120.000	93,86	31.12.2019	12,33	722810706352807230				96,74		66.865.866	2,47	2,19		
TRT120128T11	HAZİNE	12.01.2028			96,60			100.000	115,36	21.11.2018	3,22	706779551941884272				133,50		133.500	0,00	0,00		
TRT080328T15	HAZİNE	8.03.2028			0,00			3.440.000	98,55	30.12.2019	12,35	6449C5C2:013F751B				105,81		3.639.752	0,13	0,12		
GRUP TOPLAMI					2.415.396.905								2.438.476.103								90,06	79,68
Eurobond Yabancı																						
XS1772360803	AKBANK T.A.S.	27.04.2028			7,98			1.000.000	92,64	01/06/18	0,00					95,61		5.679.258	0,21	0,19		
GRUP TOPLAMI					1.000.000								5.679.258								0,21	0,19
ÖZEL SEKTÖR																						
Finansman Bonosu																						
TRFVKFB12029	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	10.01.2020			0,00			10.000	92,53	15.08.2019	21,09	09F4884200098766				99,53		9.953	0,00	0,00		
TRFKORT12021	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	29.01.2020			96,30			1.000.000	96,30	5.11.2019	15,90	720593816033611601				98,87		988.743	0,04	0,03		
TRFAKBK22022	AKBANK T.A.S.	21.02.2020			10,35			40.000.000	98,36	24.12.2019	10,81					98,58		39.430.582	1,46	1,29		
TRFZORN42037	ZORLU ELEKTRİK ÜRETİM A.Ş	17.04.2020			20,00			1.210.000	89,68	20.09.2019	16,87					95,53		1.155.938	0,04	0,04		
TRFFFKR62015	FINANS LEASING	9.06.2020			10,75			4.000.000	95,31	25.12.2019	11,06					95,50		3.820.161	0,14	0,13		
TRFZORN62019	ZORLU ELEKTRİK ÜRETİM A.Ş	11.06.2020			100,00			1.400.000	100,06	3.12.2019	22,36	721702398632026327				101,67		1.423.427	0,05	0,05		
TRFZORN62027	ZOREN	11.06.2020			91,10			750.000	91,10	20.11.2019	18,30	721187827190410035				92,81		696.096	0,03	0,02		
TRFZORN62035	ZORLU ELEKTRİK ÜRETİM A.Ş	11.06.2020			17,50			2.000.000	91,69	5.12.2019	18,29					92,82		1.856.329	0,07	0,06		
TRFFNBK62013	FINANSBANK A.S.	26.06.2020			14,00			19.500.000	100,00	27.12.2019	0,00					100,15		19.528.809	0,72	0,64		
TRFGLMD72016	GLOBAL MENKUL DEĞERLER A.Ş.	6.07.2020			0,00			500.000	100,67	17.07.2019	21,33	63632282:00F7B175				104,68		523.389	0,02	0,02		
TRFKORT82016	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	27.08.2020			23,93			1.850.000	100,00	29.08.2019	25,85					102,20		1.890.608	0,07	0,06		
GRUP TOPLAMI					72.220.000								71.324.035								2,64	2,34

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Vadeye Kalan Gün	Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
ÖZEL SEKTÖR																		
Özel Sektör Tahvil																		
TRFKORT12013	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	29.01.2020			29,79		1.100.000	100,00	4.02.2019	16,12				103,47		1.138.169	0,04	0,04
TRSHYTV22012	HAYAT VARLIK	4.02.2020			100,00		2.500.000	104,82	18.10.2018	19,44	705434849221494743			102,81		2.570.313	0,09	0,08
TRSYDAT22015	YDA INSAAT	14.02.2020			99,00		1.500.000	103,94	18.10.2019	16,30	705473332128203245			101,98		1.529.652	0,06	0,05
TRSRNSH22023	RÖNESANS HOLDİNG	19.02.2020			99,00		720.000	103,77	2.01.2019	15,43	708442013523257115			101,76		732.676	0,03	0,02
TRSDEVA52010	DEVA	4.05.2020			0,00		3.970.000	103,10	17.07.2019	19,39	63632282:00FC28F4			101,63		4.034.806	0,15	0,13
TRSYDAT72010	YDA INSAAT	22.07.2020			98,17		9.250.000	101,37	21.03.2019	21,91	711529442173897743			102,83		9.511.971	0,35	0,31
TRFAYTM72018	AYTEMİZ AKARYAKIT DAĞITIM A.Ş.	24.07.2020			20,34		2.400.000	100,00	9.08.2019	17,32				102,34		2.456.268	0,09	0,08
TRSKOTN82018	KOTON	12.08.2020			25,93		2.500.000	100,00	5.08.2019	27,94				103,84		2.596.005	0,10	0,08
TRSHYTV92015	HAYAT VARLIK	11.09.2020			99,00		490.000	101,66	11.01.2019	18,84	705434849221494242			100,93		494.555	0,02	0,02
TRSKRSNE2018	KARSN	13.10.2020			99,50		4.000.000	101,38	9.11.2018	20,10	706304562918886277			104,02		4.160.712	0,15	0,14
TRSMGTIE2015	MGROS	21.10.2020			99,98		210.000	107,11	17.07.2019	21,64	716200167568833231			103,83		218.041	0,01	0,01
TRSENJRJ22110	ENERJISA ELEKTRİK	23.02.2021			99,29		21.950.000	128,98	4.12.2019	4,81	721187827190511661			151,25		33.198.749	1,23	1,08
TRSCMSA32112	CIMSA	18.03.2021			100,25		5.680.000	100,32	30.10.2019	12,57	719050101708208556			100,42		5.704.071	0,21	0,19
TRSDEVA52119	DEVA	4.05.2021			0,00		40.000	104,39	17.07.2019	16,75	63632282:00FB1060			102,49		40.996	0,00	0,00
TRSASLN62118	ASLAN	18.06.2021			101,10		2.160.000	101,04	27.12.2019	11,61	722652376678507102			101,48		2.191.988	0,08	0,07
TRSMGTI72110	MİGROS TİCARET A.Ş.	14.07.2021			100,24		350.000	107,64	17.07.2019	21,37	716200167568832752			104,42		365.478	0,01	0,01
TRSDOGH72112	DOĞUŞ HOLDİNG	26.07.2021			96,00		8.000.000	99,78	30.10.2018	32,47	705908738732806065			90,55		7.244.024	0,27	0,24
TRSOTKO72116	OTOKOÇ	30.07.2021			19,44		10.050.000	100,00	17.09.2019	15,32				102,41		10.292.287	0,38	0,34
TRSENSAE2114	ENERJISA ELEKTRİK	15.10.2021			98,13		4.320.000	113,15	20.11.2019	4,82	721187827190514978			141,33		6.105.260	0,23	0,20
TRSYDAT32212	YDA INSAAT	16.03.2022			99,10		2.980.000	101,49	2.01.2019	15,67	708442013523257721			100,47		2.993.889	0,11	0,10
GRUP TOPLAMI							84.170.000									97.579.908	3,61	3,19
GRUP TOPLAMI							156.390.000									168.903.943	6,25	5,53
İleri Valförlü Alışlar Türk																		
Devlet Tahvili																		
TRT080720T19	HAZİNE	8.07.2020			0,00		20.000.000	103,99	2.01.2020		644F6682:015BAE35			103,99		20.797.000	0,77	0,68
TRT080720T19	HAZİNE	8.07.2020			0,00		20.000.000	103,99	2.01.2020		644F6682:015BDB8B			103,99		20.797.000	0,77	0,68
TRT240724T15	HAZİNE	24.07.2024			0,00		5.000.000	93,88	2.01.2020		0A07F082000CBAE6			93,93		4.696.600	0,17	0,15
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00		3.000.000	97,95	2.01.2020		0A07F082000C36A4			98,00		2.939.850	0,11	0,10

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Net	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
					Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
İleri Valörlü Alışlar Türk																		
Devlet Tahvili																		
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			3.000.000	97,95	2.01.2020	0A07F082000C4E93			98,00		2.939.850	0,11	0,10
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			3.000.000	97,95	2.01.2020	0A07F082000C9338			98,00		2.939.850	0,11	0,10
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			6.000.000	97,95	2.01.2020	0A07F082000CB43D			98,00		5.879.700	0,22	0,19
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			5.000.000	98,08	2.01.2020	0A07F082000D0176			98,00		4.899.750	0,18	0,16
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			500.000	98,10	2.01.2020	0A07F082000D0177			98,00		489.975	0,02	0,02
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			500.000	98,10	2.01.2020	0A07F082000D0178			98,00		489.975	0,02	0,02
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			5.000.000	98,10	2.01.2020	0A07F082000D0179			98,00		4.899.750	0,18	0,16
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			500.000	98,10	2.01.2020	0A07F082000D017A			98,00		489.975	0,02	0,02
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			5.000.000	98,10	2.01.2020	0A07F082000D017B			98,00		4.899.750	0,18	0,16
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			3.500.000	98,13	2.01.2020	0A07F082000D017C			98,00		3.429.825	0,13	0,11
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			1.500.000	98,13	2.01.2020	0A07F082000D0190			98,00		1.469.925	0,05	0,05
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			5.000.000	98,15	2.01.2020	0A07F082000D0191			98,00		4.899.750	0,18	0,16
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			5.000.000	98,15	2.01.2020	0A07F082000D0192			98,00		4.899.750	0,18	0,16
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			5.000.000	98,15	2.01.2020	0A07F082000D0193			98,00		4.899.750	0,18	0,16
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			3.500.000	98,15	2.01.2020	0A07F082000D0194			98,00		3.429.825	0,13	0,11
TRT110226T13	HAZİNE	11.02.2026			0,00			500.000	98,15	2.01.2020	0A07F082000D037F			98,00		489.975	0,02	0,02
TRT110827T16	HAZİNE	11.08.2027			0,00			15.000.000	96,69	2.01.2020	0A07F082000A635F			96,56		14.484.600	0,54	0,47
TRT110827T16	HAZİNE	11.08.2027			0,00			5.000.000	96,52	2.01.2020	0A07F082000CC224			96,56		4.828.200	0,18	0,16
TRT110827T16	HAZİNE	11.08.2027			0,00			10.000.000	96,72	2.01.2020	0A07F082000DFF76			96,56		9.656.400	0,36	0,32
TRT110827T16	HAZİNE	11.08.2027			0,00			5.000.000	96,72	2.01.2020	0A07F082000DFF77			96,56		4.828.200	0,18	0,16
GRUP TOPLAMI								135.500.000								134.475.225	4,99	4,42
İleri Valörlü Satışlar Türk																		
Devlet Tahvili																		
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00			-5.000.000	103,36	2.01.2020	0A07F082000D301D			103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00			-5.000.000	103,34	2.01.2020	0A07F082000D301E			103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00			-5.000.000	103,34	2.01.2020	0A07F082000D301F			103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00			-5.000.000	103,34	2.01.2020	0A07F082000D3020			103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00			-5.000.000	103,34	2.01.2020	0A07F082000D3021			103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00			-5.000.000	103,34	2.01.2020	0A07F082000D3022			103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

					Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç		Borsa	Repo	Net	Günlük				
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto		Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı		No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
İleri Valörlü Satışlar Türk																			
Devlet Tahvili																			
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00		-5.000.000	103,34	2.01.2020		0A07F082000D3023				103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00		-5.000.000	103,34	2.01.2020		0A07F082000D3045				103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00		-5.000.000	103,34	2.01.2020		0A07F082000D3046				103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021			0,00		-5.000.000	103,29	2.01.2020		0A07F082000D3047				103,40		-5.169.900	-0,19	-0,17
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			0,00		-500.000	96,48	2.01.2020		0A07F082000C245B				96,29		-481.440	-0,02	-0,02
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			0,00		-500.000	96,38	2.01.2020		0A07F082000C245C				96,29		-481.440	-0,02	-0,02
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			0,00		-5.000.000	96,28	2.01.2020		0A07F082000C245D				96,29		-4.814.400	-0,18	-0,16
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			0,00		-5.000.000	96,28	2.01.2020		0A07F082000C245E				96,29		-4.814.400	-0,18	-0,16
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			0,00		-4.000.000	96,25	2.01.2020		0A07F082000C245F				96,29		-3.851.520	-0,14	-0,13
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,68	2.01.2020		0A07F082000E11FF				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,68	2.01.2020		0A07F082000E1200				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,68	2.01.2020		0A07F082000E121E				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,68	2.01.2020		0A07F082000E121F				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,93	2.01.2020		0A07F082000D608B				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,93	2.01.2020		0A07F082000D608C				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,93	2.01.2020		0A07F082000D60C8				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-5.000.000	106,88	2.01.2020		0A07F082000D60C9				107,00		-5.349.900	-0,20	-0,18
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		-3.000.000	107,03	2.01.2020		0A07F082000D03E3				107,00		-3.209.940	-0,12	-0,11
TRT270923T11	HAZİNE	27.09.2023			0,00		-2.000.000	94,22	2.01.2020		0A07F082000E1615				94,47		-1.889.480	-0,07	-0,06
GRUP TOPLAMI							-110.000.000										-114.040.820	-4,23	-3,80
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet																			
TRPAKT262012	AKTİFBANK	16/06/20			95,10		3.550.000	95,10	25.12.2019	11,10	722573211841372608				95,30		3.383.017	0,12	0,11
TRPAKT292019	AKTİFBANK	23/09/20			92,24		2.200.000	92,24	25.12.2019	11,41	722573211841372989				92,43		2.033.466	0,08	0,07
TRPKYVFA2318	TKYB VARLIK FİNANSMAN FONU	07/12/23			16,99		20.000.000	100,00	7.12.2018	14,56					110,58		22.116.616	0,82	0,72
TRPTYV232410	TKYB VARLIK FİNANSMAN FONU	15/03/24			16,75		5.400.000	100,00	15.03.2019	16,49					104,38		5.636.458	0,21	0,18
GRUP TOPLAMI							31.150.000										33.169.557	1,23	1,08
GRUP TOPLAMI							250.157.534										250.079.576	100,00	8,25

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

					Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç		Borsa	Repo	Net	Günlük					
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Faiz	Ödeme		Deger/	Alış	Alış	İskonto		Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı			No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	
T.Repo																					
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319442	19.586.920	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319443	502.235	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319444	19.586.920	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319445	502.235	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319446	19.586.920	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319447	502.235	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319448	19.586.920	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319449	502.235	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319450	19.586.920	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319451	502.230	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319453	502.235	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			10.006.301	11,50	31.12.2019		722810706353319454	10.044.580	10.006.301	11,38			10.003.183	4,00	0,33	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319430	19.586.920	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319431	502.230	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319433	502.230	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319435	502.230	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319438	19.586.920	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT050220T17	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319439	502.230	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT080720T19	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319441	496.130	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT080720T19	HAZİNE	2.01.2020			11,50			500.315	11,50	31.12.2019		722810706353319437	496.130	500.315	11,38			500.159	0,20	0,02	
TRT170822T15	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319440	19.671.630	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT170822T15	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319452	19.671.630	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT170822T15	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319432	19.671.630	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT170822T15	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319434	19.671.630	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
TRT170822T15	HAZİNE	2.01.2020			11,50			19.512.288	11,50	31.12.2019		722810706353319436	19.671.630	19.512.288	11,38			19.506.207	7,80	0,64	
GRUP TOPLAMI								250.157.534								250.079.576				100,00	8,25

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

					Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç		Borsa	Repo	Net	Günlük					
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Faiz	Ödeme		Deger/	Alış	Alış	İskonto		Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı		No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)		
TPP																					
TPP		2.01.2020			10,75			8.158.803	10,75	31.12.2019			228921		8.158.803	10,78		8.156.394	20,88	0,27	
TPP		2.01.2020			10,70			5.002.932	10,70	31.12.2019			228925		5.002.932	10,78		5.001.455	12,80	0,16	
TPP		2.01.2020			10,70			2.001.173	10,70	31.12.2019			228926		2.001.173	10,78		2.000.582	5,12	0,07	
TPP		2.01.2020			10,70			2.403.408	10,70	31.12.2019			228924		2.403.408	10,78		2.402.699	6,15	0,08	
TPP		2.01.2020			10,65			1.494.872	10,65	31.12.2019			228927		1.494.872	10,78		1.494.431	3,83	0,05	
TPP		2.01.2020			10,75			10.005.890	10,75	31.12.2019			228922		10.005.890	10,78		10.002.937	25,61	0,33	
TPP		2.01.2020			10,75			10.005.890	10,75	31.12.2019			228923		10.005.890	10,78		10.002.937	25,61	0,33	
GRUP TOPLAMI								39.072.968										39.061.433	100,00	1,29	
DİĞER																					
Y.Fonu Türk																					
Bgy-Ak Portföy Yönetimi A.Ş. Birinci																					
Gayrimenkul Yatırım Fonu	AKPORTFOY							17.204.573	1,31	16.05.2019						1,41		24.178.946	90,59	0,79	
Ikg-Akportföy Yönetimi A.Ş. İkinci																					
Gayrimenkul Yatırım Fonu	AKPORTFOY							2.140.541	1,14	31.12.2019							1,17		2.512.987	9,41	0,08
GRUP TOPLAMI								19.345.114										26.691.932	100,00	0,87	
VIOP Nakit Teminatı																					
VIOP Nakit Teminatı																					
								35.511.078										35.511.078	100,00	1,16	
GRUP TOPLAMI								35.511.078										35.511.078	100,00	1,16	
Döviz																					
USD	FED							1.829.930	5,64	31.12.2019						5,940000		10.869.786	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI								1.829.930										10.869.786	0,00	0,00	
KİRA SERTİFİKALARI																					
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları																					
TRD120220T16	HAZİNE	12.02.2020			0,00			1.010.000,00	105,01	24.12.2019	9,45	0A06F482000C5F25				105,26		1.063.127	0,04	0,04	
TRD180821T13	HAZİNE	18.08.2021			107,47			5.500.000,00	112,31	18.12.2019	9,89	722296959545178215				113,03		6.216.605	0,23	0,20	
TRD151221T10	HAZİNE	15.12.2021			100,00			17.650.000,00	100,00	30.12.2019	10,12	722296959544723792				103,32		18.236.381	0,67	0,60	
GRUP TOPLAMI								24.160.000,00										25.516.113	0,94	0,84	

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Net	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
					Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
KİRA SERTİFİKALARI																		
Özel Sektör Kira Sertifikaları																		
TRDZKVK42012	ZİRAAT KATILIM VK	3.04.2020			2,66			15.000.000	100,00	27.12.2019	10,26			100,13		15.020.092	0,55	0,49
GRUP TOPLAMI								15.000.000								15.020.092	0,55	0,49
GRUP TOPLAMI																40.536.205	1,49	1,33
FON PORTFÖY DEĞERİ																3.058.543.490		100,00

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2019		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	3.058.543.490		101
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B,HAZIR DEĞERLER	10.955.749		-
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	85.962	1	-
i) TL Hesaplar			
ii) Yabancı Para TL Karşılığı			
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)			
c) Diğer Hazır Değerler	10.869.786	99	-
C,ALACAKLAR	117.099.923		4
Takastan Alacaklar	113.924.799	100	4
a) Takastan Alacaklar T1	-		-
b) Takastan Alacaklar T2	-		-
c) İleri Valörlü Takas	113.924.799		-
d) Diğer Alacaklar	3.175.125		-
D,DİĞER VARLIKLAR			
E,BORÇLAR	(144.368.102)	-	-
a) Takasa Borçlar	(134.557.747)	-	-
i) Takasa Borçlar T1			
ii) Takasa Borçlar T2			
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	(134.557.747)		
b) Yönetim Ücreti	(4.697.264)	3	-
c) İhtiyatlar	-	-	-
d) Kayda Alma ücreti	(91.286)	-	-
e) Diğer Borçlar	(5.021.805)	-	-
i) Denetim Ücreti	(10.100)	-	-
vi) Diğer	(5.011.705)	-	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı			
Fon toplam değeri	3.042.231.060		100