

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

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-4
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	5

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK 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/ ntrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk	AEFES	-	AEFES	-	-	4.056	20,808915	03/12/20	-	-	23,180000		94.018	1,45	0,72
	YAZIC	-	AGHOL	-	-	4.430	19,049427	19/10/20	-	-	26,420000		117.041	1,80	0,90
	AKBANK T.A.S.	-	AKBNK	-	-	64.997	6,257030	28/12/20	-	-	6,930000		450.428	6,93	3,46
	AKGRT	-	AKGRT	-	-	11.208	6,835317	19/10/20	-	-	9,300000		104.234	1,60	0,80
	AKSA	-	AKSA	-	-	1	7,880000	19/02/20	-	-	14,590000		7	0,00	0,00
	ALARK	-	ALARK	-	-	3.437	5,325720	25/12/20	-	-	8,640000		29.696	0,46	0,23
	ALKA	-	ALKA	-	-	3.083	13,890000	30/10/20	-	-	14,000000		43.162	0,66	0,33
	ANHYT	-	ANHYT	-	-	1.157	8,600000	31/12/20	-	-	8,670000		10.031	0,15	0,08
	ARCLK	-	ARCLK	-	-	5.706	26,468207	30/12/20	-	-	30,400000		173.462	2,67	1,33
	ARDYZ	-	ARDYZ	-	-	1.160	36,420000	11/11/20	-	-	48,080000		55.773	0,86	0,43
	ASELS	-	ASELS	-	-	5.446	14,704157	15/12/20	-	-	18,250000		99.390	1,53	0,76
	ASELS	-	ASELS	-	-	2.357	18,760000	30/12/20	-	-	18,250000		43.015	0,66	0,33
	AYGAZ	-	AYGAZ	-	-	1.893	11,406255	31/12/20	-	-	14,650000		27.732	0,43	0,21
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	3.338	61,305108	26/10/20	-	-	75,500000		252.019	3,88	1,93
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	157	76,000000	30/12/20	-	-	75,500000		11.854	0,18	0,09
	CCOLA	-	CCOLA	-	-	416	44,520000	03/11/20	-	-	65,800000		27.373	0,42	0,21
	CCOLA	-	CCOLA	-	-	386	63,150000	30/12/20	-	-	65,800000		25.399	0,39	0,19
	DOHOL	-	DOHOL	-	-	6.495	2,590000	16/12/20	-	-	3,070000		19.940	0,31	0,15
	ENERJISA ELEKTRİK	-	ENJSA	-	-	4.420	10,975000	15/12/20	-	-	12,510000		55.294	0,85	0,42
	ENKAI	-	ENKAI	-	-	1	5,833333	29/05/20	-	-	7,370000		6	0,00	0,00
	EREGL	-	EREGL	-	-	29.608	9,141748	18/12/20	-	-	14,930000		442.047	6,81	3,39
	FONET	-	FONET	-	-	4.496	12,139075	25/12/20	-	-	13,030000		58.583	0,90	0,45
	FROTO	-	FROTO	-	-	350	99,922657	04/12/20	-	-	126,000000		44.100	0,68	0,34
	T.GARANTİ BANKASI A.S.	-	GARAN	-	-	40.511	8,425203	24/12/20	-	-	10,370000		420.099	6,47	3,23
	T.İŞ BANKASI A.S.	-	ISCTR	-	-	30.625	6,344254	30/11/20	-	-	7,000000		214.375	3,30	1,65
	KCHOL	-	KCHOL	-	-	18.935	16,261123	28/12/20	-	-	21,120000		399.907	6,16	3,07
	KCHOL	-	KCHOL	-	-	864	20,760000	30/12/20	-	-	21,120000		18.248	0,28	0,14
	KORDS	-	KORDS	-	-	2.531	11,578811	04/11/20	-	-	15,550000		39.357	0,61	0,30
	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK	-	KOZAA	-	-	2.173	11,364657	28/12/20	-	-	15,490000		33.660	0,52	0,26
	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.	-	KOZAL	-	-	1.080	79,250981	04/12/20	-	-	96,700000		104.436	1,61	0,80

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK 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 Tanım	Nominal Faiz Oram	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oram	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
	KARDEMİR KARABUK DEMİR ÇELİK S.T.A.Ş.	-	KRDMD	-	-	38.615	5,124028	30/12/20	-	-	5,780000	-	223.195	3,44	1,71
	KERVAN GIDA	-	KRVGD	-	-	4.561	13,120000	29/12/20	-	-	13,220000	-	60.296	0,93	0,46
	LOGO	-	LOGO	-	-	492	98,876626	01/12/20	-	-	125,500000	-	61.746	0,95	0,47
	MAVI JEANS	-	MAVI	-	-	1.086	37,062210	19/10/20	-	-	52,200000	-	56.689	0,87	0,44
	MİGROS TİCARET A.Ş.	-	MGROS	-	-	4.504	32,893532	03/12/20	-	-	42,800000	-	192.771	2,97	1,48
	OYAK BANK A.S.	-	OYAKC	-	-	2.426	7,878347	24/12/20	-	-	8,780000	-	21.300	0,33	0,16
	PETKM	-	PETKM	-	-	33.012	3,803642	01/12/20	-	-	4,980000	-	164.399	2,53	1,26
	PGSUS	-	PGSUS	-	-	632	60,757674	09/12/20	-	-	74,600000	-	47.147	0,73	0,36
	SAHOL	-	SAHOL	-	-	14.256	8,882355	11/12/20	-	-	11,460000	-	163.374	2,52	1,25
	SISE	-	SISE	-	-	38.234	6,543273	18/12/20	-	-	7,310000	-	279.492	4,30	2,15
	ŞOK MARKET	-	SOKM	-	-	1.526	12,630000	03/12/20	-	-	12,620000	-	19.258	0,30	0,15
	TAV	-	TAVHL	-	-	2.258	18,444212	27/11/20	-	-	21,300000	-	48.095	0,74	0,37
	TCELL	-	TCELL	-	-	29.966	14,611291	18/12/20	-	-	16,100000	-	482.453	7,43	3,70
	THYAO	-	THYAO	-	-	3.922	11,355446	09/12/20	-	-	12,910000	-	50.633	0,78	0,39
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	TKFEN	-	-	5.378	15,874517	29/12/20	-	-	16,590000	-	89.221	1,37	0,68
	TOASO	-	TOASO	-	-	4.523	24,525892	26/11/20	-	-	33,920000	-	153.420	2,36	1,18
	TSKB	-	TSKB	-	-	11.292	1,919936	28/12/20	-	-	1,780000	-	20.099	0,31	0,15
	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	TTKOM	-	-	21.256	7,033797	17/12/20	-	-	8,540000	-	181.526	2,79	1,39
	TUPRS	-	TUPRS	-	-	2.502	90,409309	15/12/20	-	-	108,000000	-	270.216	4,16	2,07
	GUSGR	-	TURSG	-	-	19.687	6,053270	30/12/20	-	-	6,600000	-	129.934	2,00	1,00
	ULKER	-	ULKER	-	-	2.256	22,640000	28/12/20	-	-	23,140000	-	52.204	0,80	0,40
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	-	VAKBN	-	-	10.357	4,090000	06/11/20	-	-	4,710000	-	48.781	0,75	0,37
	YATAS	-	YATAS	-	-	6.190	9,332419	11/12/20	-	-	14,450000	-	89.438	1,38	0,69
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	-	YKBNK	-	-	56.845	2,604149	11/12/20	-	-	3,080000	-	175.083	2,70	1,34
GRUP TOPLAMI						571.092							6.495.458	100,00	49,87

BORÇLANMA SENETLERİ

Devlet Tahvili	HAZİNE	-	TRT170221T12	-	-	525.000	102,026200	30/11/20	-	-	103,462793	-	543.180	16,16	0,40
	HAZİNE	-	TRT210421T14	-	-	200.000	117,065700	14/01/20	-	-	105,758713	-	211.517	6,29	0,40
	HAZİNE	-	TRT220921T18	-	-	180.000	101,681800	13/03/20	-	-	98,142914	-	176.657	5,26	0,40

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK 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 Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
	HAZİNE	-	TRT040522T13	-	-	100.000	94,363700	15/12/20	-	-	94,609031	-	94.609	2,82	0,73
	HAZİNE	-	TRT180123T10	-	-	190.000	101,509300	14/04/20	-	-	102,500834	-	194.752	5,80	1,50
	HAZİNE	-	TRT240724T15	-	-	200.000	90,021400	10/11/20	-	-	92,614111	-	185.228	5,51	1,42
	HAZİNE	-	TRT110226T13	-	-	75.000	94,438400	17/11/20	-	-	97,138146	-	72.854	2,17	0,56
	HAZİNE	-	TRT110827T16	-	-	80.000	95,541200	03/11/20	-	-	95,146619	-	76.117	2,27	0,58
	HAZİNE	-	TRT080328T15	-	-	95.000	103,273300	07/07/20	-	-	102,895407	-	97.751	2,91	0,75
	HAZİNE	-	TRT131130T14	-	-	120.000	94,092900	15/12/20	-	-	96,597219	-	115.917	3,45	0,89
ARA GRUP TOPLAMI						1.765.000							1.963.333	52,63	13,58
Özel Sektör															
Finansman Bonosu	İŞ LEASING	-	TRFISFN22114	-	-	320.000	96,205000	26/11/20	-	-	97,705402	-	312.657	9,30	2,40
	ALTERNATİFBANK A.Ş.	-	TRFALNF32123	-	-	200.000	95,907000	01/12/20	-	-	97,252107	-	194.504	5,79	1,49
	FINANSBANK A.Ş.	-	TRFFNBK42114	-	-	250.000	100,000000	27/11/20	-	-	100,264000	-	250.660	7,46	1,92
	AK YATIRIM	-	TRFAKYM42127	-	-	200.000	100,000000	30/11/20	-	-	100,110000	-	200.220	5,96	1,54
	MEDICAL PARK SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	-	TRSMPCA2111	-	-	120.000	100,000000	04/12/20	-	-	101,906460	-	122.288	3,64	0,94
ARA GRUP TOPLAMI						1.090.000							1.080.329	32,15	8,29
Özel Sektör Tahvil															
Özel Sektör Tahvil	ARCLK	-	TRSARCL22117	-	-	50.000	100,339200	20/02/19	-	-	102,481448	-	51.241	1,52	0,39
	OTOKOÇ	-	TRSOTKO72116	-	-	390.000	100,089000	03/02/20	-	-	102,425713	-	399.460	11,89	3,07
	AKFEN HOLDING	-	TRSAKFH22212	-	-	60.000	100,000000	07/02/20	-	-	101,086646	-	60.652	1,80	0,47
ARA GRUP TOPLAMI						500.000							511.353	15,22	3,93
GRUP TOPLAMI						1.590.000							1.591.682	47,37	12,22
GRUP TOPLAMI						3.355.000							3.360.264	100,00	25,80

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK 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 Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
T.REPO	HAZİNE		TRT261022T10			1.001.963	17,91	31/12/20			17,910000		1.000.490	100,00	7,68
GRUP TOPLAMI						1.001.963							1.000.490	100,00	7,68
MEVDUAT	-	-	TC ZIRAAT BANKASI	-	-	271.027	-	11/12/20	-	-	16,750000	-	273.624	37,25	2,10
	-	-	AKBANK T.A.S.	-	-	161.183	-	14/12/20	-	-	16,750000	-	162.507	22,13	1,25
	-	-	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	-	-	297.780	-	28/12/20	-	-	18,000000	-	298.361	40,62	2,29
GRUP TOPLAMI						729.990							734.492	100,00	5,64
TPP	-	-	TPP	-	-	928.813	-	31/12/20	-	-	17,85	-	927.453	100	7,12
GRUP TOPLAMI						928.813							927.453	100,00	7,12
TÜREV															
Uzun	-	-	F_XAUTRYM0221	-	-	600	-	31/12/20	-	-	466,190000	-	279.714	0,00	0,00
	-	-	F_XAUTRYM1220	-	-	413	-	30/10/20	-	-	451,510000	-	186.474	0,00	0,00
	-	-	F_XU0300221	-	-	22	-	31/12/20	-	-	1.658,500000	-	364.870	0,00	0,00
ARA GRUP TOPLAMI						1.035							831.058	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1.035							831.058	0,00	0,00
VIOP NAKİT TEMİNATI	-	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	507.011	-	-	-	-	-	-	507.011	100,00	3,89
GRUP TOPLAMI						507.011							507.011	100,00	3,89
FON PORTFÖY DEĞERİ						7.093.868							13.025.168		100,00

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DİNAMİK 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	13.025.168	-	101,25
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	-	-	-
B,HAZIR DEĞERLER	5.576	-	0,04
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	5.576	100,00	0,04
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	24.246	-	0,19
a) Takastan Alacaklar	11.994	49,47	0,09
i) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas	11.994	49,47	0,09
iv) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	12.252	50,53	0,10
i) Diğer Alacaklar	7.178	29,61	0,06
ii) Temettü	5.073	20,93	0,04
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(191.256)	-	(1,49)
a) Takasa Borçlar	(108.412)	56,68	(0,84)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	(98.462)	51,48	(0,77)
iii) İleri Valörlü Takas	(9.950)	5,20	(0,08)
b) Yönetim Ücreti	(8.648)	4,52	(0,07)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Krediler	-	-	-
f) Diğer Borçlar	(73.810)	38,79	(0,57)
i) Denetim Ücreti	(4.108)	2,15	(0,03)
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(69.702)	36,44	(0,54)
h)Kayda Alma Ücreti	(386)	0,20	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	12.863.733		100,00