

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS DENGELİ 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 DENGELİ 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 Dengeli 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 Dengeli 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 DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK
YATIRIM FONU**

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

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DENGELİ 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 Aış Fiyatı	Satın Aış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk	AEFES	-	AEFES	-	-	2.750	20,62	03/12/20	-	-	23,180000	-	63.745	1,45	0,56
	YAZIC	-	AGHOL	-	-	2.986	19,06	12/11/20	-	-	26,420000	-	78.890	1,79	0,69
	AKBANK T.A.S.	-	AKBNK	-	-	44.342	6,18	28/12/20	-	-	6,930000	-	307.291	6,97	2,70
	AKGRT	-	AKGRT	-	-	7.557	6,79	12/11/20	-	-	9,300000	-	70.280	1,59	0,62
	ALARK	-	ALARK	-	-	2.338	5,14	25/12/20	-	-	8,640000	-	20.200	0,46	0,18
	ALKA	-	ALKA	-	-	2.094	13,89	12/11/20	-	-	14,000000	-	29.316	0,67	0,26
	ANHYYT	-	ANHYYT	-	-	785	8,60	31/12/20	-	-	8,670000	-	6.806	0,15	0,06
	ARCLK	-	ARCLK	-	-	3.872	26,47	30/12/20	-	-	30,400000	-	117.709	2,67	1,04
	ARDYZ	-	ARDYZ	-	-	787	36,42	12/11/20	-	-	48,080000	-	37.839	0,86	0,33
	ASELS	-	ASELS	-	-	3.693	14,65	15/12/20	-	-	18,250000	-	67.397	1,53	0,59
	ASELS	-	ASELS	-	-	1.602	18,76	30/12/20	-	-	18,250000	-	29.237	0,66	0,26
	AYGAZ	-	AYGAZ	-	-	1.284	11,43	31/12/20	-	-	14,650000	-	18.811	0,43	0,17
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	2.253	61,42	12/11/20	-	-	75,500000	-	170.102	3,86	1,50
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	118	76,00	30/12/20	-	-	75,500000	-	8.909	0,20	0,08
	CCOLA	-	CCOLA	-	-	281	44,54	12/11/20	-	-	65,800000	-	18.490	0,42	0,16
	CCOLA	-	CCOLA	-	-	263	63,15	30/12/20	-	-	65,800000	-	17.305	0,39	0,15
	DOHOL	-	DOHOL	-	-	4.405	2,59	16/12/20	-	-	3,070000	-	13.523	0,31	0,12
	ENERJISA ELEKTRİK	-	ENJSA	-	-	2.998	10,98	15/12/20	-	-	12,510000	-	37.505	0,85	0,33
	EREGL	-	EREGL	-	-	20.064	9,04	18/12/20	-	-	14,930000	-	299.556	6,80	2,64
	FONET	-	FONET	-	-	3.060	12,21	25/12/20	-	-	13,030000	-	39.872	0,90	0,35
	FROTO	-	FROTO	-	-	238	100,10	04/12/20	-	-	126,000000	-	29.988	0,68	0,26
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	GARAN	-	-	27.650	8,30	24/12/20	-	-	10,370000	-	286.731	6,51	2,52
	T.İŞ BANKASI A.Ş.	-	ISCTR	-	-	20.760	6,10	30/11/20	-	-	7,000000	-	145.320	3,30	1,28
	KCHOL	-	KCHOL	-	-	12.916	16,21	28/12/20	-	-	21,120000	-	272.786	6,19	2,40
	KCHOL	-	KCHOL	-	-	519	20,76	30/12/20	-	-	21,120000	-	10.961	0,25	0,10
	KORDS	-	KORDS	-	-	1.708	11,58	12/11/20	-	-	15,550000	-	26.559	0,60	0,23
	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK	-	KOZAA	-	-	1.488	11,62	28/12/20	-	-	15,490000	-	23.049	0,52	0,20
	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.	-	KOZAL	-	-	732	75,88	04/12/20	-	-	96,700000	-	70.784	1,61	0,62
	KARDEMİR KARABUK DEMİR ÇELİK S.T.A.Ş.	-	KRDMD	-	-	26.205	5,12	30/12/20	-	-	5,780000	-	151.465	3,44	1,33
	KERVAN GIDA	-	KRVGD	-	-	3.095	13,12	29/12/20	-	-	13,220000	-	40.916	0,93	0,36

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DENGELİ 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 (%)
	LOGO	-	LOGO	-	-	334	99,17	01/12/20	-	-	125,500000	-	41.917	0,95	0,37
	MAVI JEANS	-	MAVI	-	-	732	37,07	12/11/20	-	-	52,200000	-	38.210	0,87	0,34
	MİGROS TİCARET A.Ş.	-	MGROS	-	-	3.053	32,51	03/12/20	-	-	42,800000	-	130.668	2,96	1,15
	OYAK BANK A.S.	-	OYAKC	-	-	1.654	7,88	24/12/20	-	-	8,780000	-	14.522	0,33	0,13
	PETKM	-	PETKM	-	-	22.336	3,80	01/12/20	-	-	4,980000	-	111.235	2,52	0,98
	PGSUS	-	PGSUS	-	-	428	60,67	09/12/20	-	-	74,600000	-	31.929	0,72	0,28
	SAHOL	-	SAHOL	-	-	9.668	8,65	11/12/20	-	-	11,460000	-	110.795	2,51	0,97
	SISE	-	SISE	-	-	25.910	6,54	18/12/20	-	-	7,310000	-	189.404	4,30	1,67
	ŞOK MARKET	-	SOKM	-	-	1.035	12,63	03/12/20	-	-	12,620000	-	13.062	0,30	0,11
	TAV	-	TAVHL	-	-	1.531	17,53	27/11/20	-	-	21,300000	-	32.610	0,74	0,29
	TCELL	-	TCELL	-	-	20.292	14,58	18/12/20	-	-	16,100000	-	326.701	7,41	2,87
	THYAO	-	THYAO	-	-	2.660	11,24	09/12/20	-	-	12,910000	-	34.341	0,78	0,30
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	-	TKFEN	-	-	3.650	15,79	29/12/20	-	-	16,590000	-	60.554	1,37	0,53
	TOASO	-	TOASO	-	-	3.066	24,40	26/11/20	-	-	33,920000	-	103.999	2,36	0,91
	TSKB	-	TSKB	-	-	7.703	1,92	28/12/20	-	-	1,780000	-	13.710	0,31	0,12
	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	-	TTKOM	-	-	14.416	6,96	17/12/20	-	-	8,540000	-	123.113	2,79	1,08
	TUPRS	-	TUPRS	-	-	1.697	90,10	15/12/20	-	-	108,000000	-	183.276	4,16	1,61
	GUSGR	-	TURSG	-	-	13.360	6,05	30/12/20	-	-	6,600000	-	88.176	2,00	0,78
	ULKER	-	ULKER	-	-	1.540	22,72	28/12/20	-	-	23,140000	-	35.636	0,81	0,31
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	-	VAKBN	-	-	6.992	4,09	12/11/20	-	-	4,710000	-	32.932	0,75	0,29
	YATAS	-	YATAS	-	-	4.198	9,53	11/12/20	-	-	14,450000	-	60.661	1,38	0,53
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	-	YKBNK	-	-	38.551	2,60	11/12/20	-	-	3,080000	-	118.737	2,69	1,04
GRUP TOPLAMI						387.649							4.407.530	100,00	38,77
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili															
	HAZİNE	-	TRT170221T12	-	-	565.000	101,400500	30/11/20	-	-	103,462793		584.565	13,82	5,14
	HAZİNE	-	TRT140421T13	-	-	200.000	88,497800	12/02/20	-	-	95,992114		191.984	4,54	1,69
	HAZİNE	-	TRT210421T14	-	-	220.000	117,065700	14/01/20	-	-	105,758713		232.669	5,50	2,05
	HAZİNE	-	TRT220921T18	-	-	200.000	101,775800	13/03/20	-	-	98,142914		196.286	4,64	1,73
	HAZİNE	-	TRT201021T25	-	-	210.000	108,732600	12/02/20	-	-	101,333892		212.801	5,03	1,87

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DENGELİ 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	(%)	(%)
				Oran	Sayı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutarı	Deger				
	HAZİNE	-	TRT120122T17	-	-	30.000	98,575300	08/11/19	-	-	99,064143	-	29.719	0,70	0,56
	HAZİNE	-	TRT040522T13	-	-	125.000	94,436800	22/12/20	-	-	94,609031	-	118.261	2,80	0,56
	HAZİNE	-	TRT180123T10	-	-	225.000	101,029100	14/04/20	-	-	102,500834	-	230.627	5,45	0,56
	HAZİNE	-	TRT240724T15	-	-	200.000	90,021400	10/11/20	-	-	92,614111	-	185.228	4,38	0,56
	HAZİNE	-	TRT110226T13	-	-	50.000	92,445100	17/11/20	-	-	97,138146	-	48.569	1,15	0,56
	HAZİNE	-	TRT110827T16	-	-	80.000	94,914300	16/12/20	-	-	95,146619	-	76.117	1,80	0,56
	HAZİNE	-	TRT080328T15	-	-	120.000	102,533000	14/07/20	-	-	102,895407	-	123.474	2,92	0,56
	HAZİNE	-	TRT131130T14	-	-	100.000	94,092900	15/12/20	-	-	96,597219	-	96.597	2,28	0,56
ARA GRUP TOPLAMI						2.325.000							2.326.899	55,02	20,47
Özel Sektör															
Finansman Bonosu	AKBANK T.A.S.	-	TRSAKBK12117	-	-	180.000	82,231000	11/10/19	-	-	98,860119	-	177.948	4,21	0,56
	İŞ LEASING	-	TRFISFN22114	-	-	300.000	96,205000	26/11/20	-	-	97,705402	-	293.116	6,93	0,56
	ALTERNATİFBANK A.S.	-	TRFALNF32123	-	-	200.000	95,907000	01/12/20	-	-	97,252107	-	194.504	4,60	0,56
	FINANSBANK A.S.	-	TRFFNBK42114	-	-	250.000	100,000000	27/11/20	-	-	100,264000	-	250.660	5,93	0,56
	FINANSBANK A.S.	-	TRFFNBK42122	-	-	100.000	100,000000	04/12/20	-	-	101,438000	-	101.438	2,40	0,56
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	-	TRFVKFB42158	-	-	120.000	100,000000	04/12/20	-	-	101,320000	-	121.584	2,87	0,56
	AK YATIRIM	-	TRFAKYM42127	-	-	200.000	100,000000	30/11/20	-	-	100,110000	-	200.220	4,73	0,56
	MEDICAL PARK SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	-	TRSM LPCA2111	-	-	100.000	100,000000	04/12/20	-	-	101,906460	-	101.906	2,41	0,56
ARA GRUP TOPLAMI						1.450.000							1.441.377	34,08	12,68
Özel Sektör															
Özel Sektör Tahvil	ARCLK	-	TRSARCL22117	-	-	60.000	100,339200	20/02/19	-	-	102,481448	-	61.489	1,45	0,56
	OTOKOÇ	-	TRSOTKO72116	-	-	390.000	100,089000	03/02/20	-	-	102,425713	-	399.460	9,45	0,56
ARA GRUP TOPLAMI						450.000							460.949	10,90	4,06
GRUP TOPLAMI						1.900.000							1.902.326	44,98	16,73
GRUP TOPLAMI						4.225.000							4.229.225	100,00	37,20

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DENGELİ 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	17,910000	31/12/20	-	-	17,910000	-	1.000.490	100,00	8,80
GRUP TOPLAMI						1.001.963							1.000.490	100,00	8,80
MEVDUAT	-	-	TC ZIRAAT BANKASI	-	-	363.057		11/12/20	-	-	16,750000	-	366.537	44,87	3,22
	-	-	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	-	-	449.438		28/12/20	-	-	18,000000	-	450.315	55,13	3,96
GRUP TOPLAMI						812.495							816.852	100,00	7,19
TPP	-	-	TPP	-	-	578.129	17,850000	31/12/20	-	-	17,850000	-	577.282	100,00	5,08
GRUP TOPLAMI						578.129							577.282	100,00	5,08
TÜREV															
Uzun	-	-	F_XAUTRYM0221	-	-	775	466,190000	31/12/20	-	-	466,190000	-	361.297	0,00	0,00
	-	-	F_XAUTRYM1220	-	-	411	445,400000	30/10/20	-	-	451,510000	-	185.571	0,00	0,00
TÜREV															
Kısa	-	-	F_XU0300221	-	-	7	1.658,50	31/12/20	-	-	1.658,50	-	116.095	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1.193							662.963	0,00	0,00
VIOP NAKİT TEMİNATI	-	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	335.981	-	-	-	-	-	-	335.981	100,00	2,96
GRUP TOPLAMI						335.981							335.981	100,00	2,96
FON PORTFÖY DEĞERİ						7.341.216							11.367.360		100,00

AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS DENGELİ 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	11.367.360	-	101,13
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	-	-	-
B,HAZIR DEĞERLER	6.204	-	0,06
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	6.204	100,00	0,06
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	20.538	-	0,18
a) Takastan Alacaklar	8.056	39,22	0,07
i) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
ii) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas	8.056	39,22	0,07
iv) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	12.482	60,78	0,11
i) Diğer Alacaklar	9.131	44,46	0,08
ii) Temettü	3.351	16,32	0,03
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(153.920)	-	(1,37)
a) Takasa Borçlar	(73.155)	47,53	(0,65)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	(66.404)	43,14	-0,59
iii) İleri Valörlü Takas	(6.751)	4,39	-0,06
b) Yönetim Ücreti	-	-	-
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Krediler	-	-	-
f) Diğer Borçlar	(72.688)	47,44	(0,65)
i) Denetim Ücreti	(4.109)	2,67	(0,04)
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(68.579)	44,55	(0,61)
h)Kayda Alma Ücreti	(337)	0,22	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	11.240.182		100,00