

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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

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

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

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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 (%)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk	SAHOL	-	SAHOL	-	-	1	9,46	09/10/19	-	-	11,460000	-	11	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						1							11	100,00	0,00
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili	HAZINE	17/02/21	TRT170221T12	100,90	-	480.000	103,10	06/11/20	15,07	-	103,46279	-	496.621	0,19	0,15
	HAZINE	09/06/21	TRT090621T18	92,32	-	3.500.000	91,01	17/12/20	16,07	-	93,71426	-	3.279.999	1,26	1,00
	HAZINE	21/07/21	TRT210721T11	0,00	-	6.000.000	254,10	28/10/20	0,47	-	262,65918	-	15.759.551	6,04	4,80
	HAZINE	22/09/21	TRT220921T18	95,60	-	5.100.000	98,02	30/12/20	16,44	-	98,14291	-	5.005.289	1,92	1,52
	HAZINE	12/01/22	TRT120122T17	95,40	-	6.000.000	98,66	13/11/20	15,94	-	99,06414	-	5.943.849	2,28	1,81
	HAZINE	02/03/22	TRT020322T17	0,00	-	9.800.000	100,99	16/11/20	15,69	-	99,39168	-	9.740.385	3,74	2,97
	HAZINE	04/05/22	TRT040522T13	93,15	-	2.500.000	94,40	31/12/20	15,13	-	94,60903	-	2.365.226	0,91	0,72
	HAZINE	17/08/22	TRT170822T15	94,70	-	6.000.000	103,48	14/10/20	15,16	-	98,47606	-	5.908.564	2,27	1,80
	HAZINE	09/11/22	TRT091122T10	0,00	-	3.000.000	101,61	27/11/20	15,00	-	101,04769	-	3.031.431	1,16	0,92
	HAZINE	18/01/23	TRT180123T10	96,80	-	7.000.000	103,44	31/12/20	14,42	-	102,50083	-	7.175.058	2,75	2,19
	HAZINE	08/03/23	TRT080323T10	86,00	-	6.500.000	89,44	21/12/20	14,37	-	89,82005	-	5.838.303	2,24	1,78
	HAZINE	14/06/23	TRT140623T19	0,00	-	1.400.000	113,32	03/12/20	14,44	-	105,30692	-	1.474.297	0,57	0,45
	HAZINE	27/09/23	TRT270923T11	87,65	-	4.600.000	94,68	27/10/20	14,24	-	91,25727	-	4.197.835	1,61	1,28
	HAZINE	24/07/24	TRT240724T15	0,00	-	6.327.000	93,04	27/11/20	13,49	-	92,61411	-	5.859.695	2,25	1,79
	HAZINE	12/03/25	TRT120325T12	0,00	-	7.000.000	86,02	09/11/20	13,37	-	86,75982	-	6.073.187	2,33	1,85
	HAZINE	01/10/25	TRT011025T16	99,50	-	13.500.000	100,80	31/12/20	13,20	-	102,38278	-	13.821.676	5,30	4,21
	HAZINE	11/02/26	TRT110226T13	0,00	-	28.500.000	94,37	30/12/20	12,85	-	97,13815	-	27.684.372	10,62	8,43
	HAZINE	24/02/27	TRT240227T17	88,10	-	19.000.000	93,45	09/11/20	13,00	-	97,01550	-	18.432.944	7,07	5,62
	HAZINE	11/08/27	TRT110827T16	90,75	-	9.300.000	94,76	25/12/20	12,90	-	95,14662	-	8.848.636	3,39	2,70
	HAZINE	08/03/28	TRT080328T15	99,25	-	400.000	100,66	13/11/20	12,98	-	102,89541	-	411.582	0,16	0,13
	HAZINE	13/11/30	TRT131130T14	0,00	-	3.000.000	96,88	31/12/20	12,95	-	96,59722	-	2.897.917	1,11	0,88
ARA GRUP TOPLAMI						148.907.000							154.246.414	59,16	46,99

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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 (%)
Özel Sektör															
Finansman Bonosu	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	08/01/21	TRFYKBK12155	100,98	-	17.000.000	100,58	12/11/20	0,00	-	101,455000	"	17.247.350	6,61	5,25
	AKBANK T.A.Ş.	29/01/21	TRSAKBK12117	93,51	-	2.300.000	89,58	18/08/20	16,12	-	98,860119	-	2.273.783	0,87	0,69
	VAKİF FAKTORİNG A.Ş.	01/02/21	TRFVFAS22114	96,90	-	12.000.000	96,83	20/11/20	17,03	-	98,673275	-	11.840.793	4,54	3,61
	FINANSBANK A.Ş.	16/02/21	TRFFFKR22126	16,00	-	7.700.000	96,16	17/11/20	16,98	-	98,042747	-	7.549.292	2,90	2,30
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	17/02/21	TRFGGRAN22129	24,00	-	5.000.000	100,00	25/11/20	0,00	-	100,421000	-	5.021.050	1,93	1,53
	AKBANK T.A.Ş.	18/02/21	TRFAKBK22170	2,00	-	3.500.000	100,00	04/12/20	0,00	-	101,288000	-	3.545.080	1,36	1,08
	FINANS LEASING	23/02/21	TRFFFKR22134	16,00	-	2.000.000	96,16	24/11/20	16,99	-	97,747569	-	1.954.951	0,75	0,60
	T.VAKİFLAR BANKASI T.A.O.	12/03/21	TRFVKFB32126	0,00	-	6.000.000	100,62	29/12/20	0,00	-	100,928000	-	6.055.680	2,32	1,84
	FINANSBANK A.Ş.	02/04/21	TRFFNBK42114	24,00	-	5.000.000	100,00	27/11/20	0,00	-	100,264000	-	5.013.200	1,92	1,53
	HSBC BANK A.Ş.	05/05/21	TRFHSHBC52115	15,00	-	380.000	92,06	18/12/20	19,42	-	94,147775	-	357.762	0,14	0,11
ARA GRUP TOPLAMI						60.880.000							60.858.940	23,34	18,54
Özel Sektör Tahvil	CİMSA	18/03/21	TRSCMSA32112	24,87	-	960.000	100,00	21/03/19	18,41	-	100,699711	-	966.717	0,37	0,29
	İSGYO	23/03/21	TRISGY32111	15,68	-	2.270.000	100,00	27/03/18	16,98	-	100,442811	-	2.280.052	0,87	0,69
	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	20/01/22	TRSTTLK12216	8,00	-	5.000.000	100,00	14/12/20	0,00	-	100,736000	-	5.036.800	1,93	1,53
	T.İŞ BANKASI A.Ş.	07/02/22	TRSTİSB22212	8,00	-	3.000.000	100,00	10/02/20	0,00	-	102,176000	-	3.065.280	1,18	0,93
	ENERJİSA ELEKTRİK	26/07/22	TRSENSA72211	0,00	-	8.600.000	156,94	15/10/20	3,54	-	163,854623	-	14.091.498	5,40	4,29
	TUPRS	28/11/22	TRSTPRSK2217	12,00	-	10.210.000	100,00	30/11/20	0,00	-	101,429000	-	10.355.901	3,97	3,15
ARA GRUP TOPLAMI						30.040.000							35.796.248	13,73	10,91
GRUP TOPLAMI						90.920.000							96.655.188	37,07	29,45
İleri Valörlü Alışlar Türk Devlet Tahvil															
HAZİNE		22/09/21	TRT220921T18	0,00	-	10.000.000	98,30	04/01/21	-	-	98,342000	-	9.834.200	3,77	3,00
ARA GRUP TOPLAMI						10.000.000							9.834.200	3,77	3,00
GRUP TOPLAMI						249.827.000							260.735.802	100,00	79,43

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP 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	04/01/21	TRT070727T13	17,25	-	5.009.452	17,25	31/12/20	-	3.048.225,00	17,250000	-	5.002.361	21,74	1,52
	HAZİNE	04/01/21	TRT100124T17	17,25	-	5.009.452	17,25	31/12/20	-	3.843.345,00	17,250000	-	5.002.361	21,74	1,52
	HAZİNE	04/01/21	TRT100124T17	17,25	-	5.009.452	17,25	31/12/20	-	3.843.345,00	17,250000	-	5.002.361	21,74	1,52
	HAZİNE	04/01/21	TRT140623T19	17,25	-	5.009.452	17,25	31/12/20	-	4.889.565,00	17,250000	-	5.002.361	21,74	1,52
	HAZİNE	04/01/21	TRT261022T10	17,25	-	1.001.890	17,25	31/12/20	-	431.785,00	17,250000	-	1.000.472	4,35	0,30
	HAZİNE	04/01/21	TRT261022T10	17,25	-	1.001.890	17,25	31/12/20	-	431.785,00	17,250000	-	1.000.472	4,35	0,30
	HAZİNE	04/01/21	TRT261022T10	17,25	-	1.001.890	17,25	31/12/20	-	431.785,00	17,250000	-	1.000.472	4,35	0,30
GRUP TOPLAMI						23.043.479							23.010.862	100,00	7,01
MEVDUAT	AKBANK T.A.S.	04/01/21	-	17,25	-	5.400.000	-	31/12/20	-	-	17,250000	-	5.402.571	34,71	1,65
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	01/02/21	-	18,50	-	10.148.770	-	29/12/20	-	-	18,500000	-	10.164.484	65,29	3,10
GRUP TOPLAMI						15.548.770							15.567.055	100,00	4,74
TPP	-	18/01/21	-	16,80	-	1.027.616	16,80	19/11/20	-	-	18,000000	-	1.019.077	3,84	0,31
	-	09/02/21	-	16,80	-	5.207.123	16,80	11/11/20	-	-	16,500000	-	5.117.893	19,27	1,56
	-	10/02/21	-	16,80	-	5.207.123	16,80	12/11/20	-	-	16,740000	-	5.114.353	19,25	1,56
	-	15/02/21	-	17,00	-	10.423.836	17,00	16/11/20	-	-	17,500000	-	10.204.555	38,42	3,11
	-	12/05/21	-	17,50	-	5.424.315	17,50	16/11/20	-	-	17,500000	-	5.106.972	19,23	1,56
GRUP TOPLAMI						27.290.014							26.562.850	100,00	8,09
VIOP Nakst Teminatı	-	-	-	-	-	2.370.052	-	-	-	-	-	-	2.370.052	100,00	0,72
GRUP TOPLAMI						2.370.052							2.370.052	100,00	0,72
FON PORTFÖY DEĞERİ						318.079.316							328.246.632		100,00
TÜREV															
Kısa	-	-	F_USDTRY0221	-	-	600	7,58	31/12/20	-	-	7,583700	-	4.550.220	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						600							4.550.220	100,00	0,00

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2020		Toplam %
	Tutar TL	Grup %	
A,FON PORTFOY DEGERI	328.246.632	-	103,16
(MIZANDAN PORTFOY DEGERI	-	-	-
B,HAZIR DEGERLER	78.645	-	0,02
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	78.645	100,00	0,02
i) TL Hesaplar	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacak)	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-
D,DİGER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	(10.119.378)	-	(3,18)
a)Takasa Borçlar	(9.830.430)	97,14	(3,09)
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii)İleri Valörlü Takas	(9.830.430)	97,14	(3,09)
b) Yönetim Ücreti	(270.517)	2,67	(0,09)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-
e) Krediler	-	-	-
f) Diğer Borçlar	(8.873)	0,18	-
i) Denetim Ücreti	(6.019)	0,06	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-
vi) Diğer	(2.854)	0,03	-
ı)Kayda Alma Ücreti	(9.558)	0,09	0,00
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	318.205.899		100,00