

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHİ 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

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS TEMKİNLİ 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**

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli 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 ilişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2018 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli 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 ilişkin 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 NN Hayat ve Emeklilik 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.



Talar Gül, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 25 Nisan 2019

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FONU TANITICI BİLGİLER.....	1
II- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER.....	2-3
III- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	4-6
IV- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	7
V- YIL İÇİNDE YAPILAN GİDERLER.....	8
VI- DİĞER AÇIKLAMALAR.....	9
VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR.....	10
VIII- İTFALAR.....	11
IX- PORTFÖYE ALIŞLAR.....	12
X- FİYAT RAPORLARINA İLİŞKİN PORTFÖY DEĞERLEME ESASLARI.....	13

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç Repo	Günlük					
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto minat	Birim	ünlük	Toplam	Grup	Toplam	
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.	10.07.2019	TRT100719T18	4,25%	6	15.000,00	94,456	13.07.2018	11,81%		98,396	1	14.759,39	9,81%	9,38%
	T.C.	12.06.2019	TRT120619T17	0,00%	0	40.000,00	87,829	14.11.2018	21,96%		91,616	1	36.646,24	24,37%	23,28%
	T.C.	13.11.2019	TRT131119T19	6,50%	6	36.000,00	94,342	11.12.2018	12,42%		96,267	1	34.656,27	23,05%	22,02%
	T.C.	15.05.2019	TRT150519T15	5,55%	6	25.000,00	97,909	31.10.2018	22,60%		97,996	1	24.499,09	16,29%	15,57%
	T.C.	18.09.2019	TRT180919T18	0,00%	0	10.000,00	85,755	16.11.2018	21,33%		87,181	1	8.718,13	5,80%	5,54%
	T.C.	27.03.2019	TRT270319T13	5,20%	6	31.000,00	98,087	22.11.2018	22,96%		100,313	1	31.096,89	20,68%	19,76%
ARA GRUP TOPLAMI						157.000,00					150.376,02			95,55%	
GRUP TOPLAMI						157.000,00					150.376,02			95,55%	
K.BORSA PARA PİYASASI															
		02.01.2019		23,80%		7.009,13	100,000	31.12.2018	0,00%		100,130	1	7.009,13	100,00%	4,45%
GRUP TOPLAMI						7.009,13					7.009,13			4,45%	
FON PORTFÖY DEĞERİ						164.009,13					157.385,15			97,88	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2018 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2018		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	157.385	-	97,88%
B.HAZIR DEĞERLER	410	-	0,26%
b) Bankalar	410	100,00%	0,26%
i) TL Hesaplar	410	100,00%	0,26%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	4.701	-	2,92%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	4.701	100,00%	2,92%
d) Diğer Alacaklar	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	1.697	-	-1,06%
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	115	6,77%	-0,07%
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	1.582	93,23%	-0,98%
i) Denetim Ücreti	620	36,51%	-0,39%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	130	7,64%	-0,08%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	9	0,54%	-0,01%
iv) Noter masrafı	-	-	-
v) İlan giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	-	-	-
vii) Diğer	824	48,55%	-0,51%
M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	160.800		100,00%
Fon toplam değeri (TL)	160.800		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	14.328.143		
Birim pay değeri (TL)	0,011223		