

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

NN Hayat ve Emeklilik 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 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 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 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 DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

---

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

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

**31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU**

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

| Menkul                | İhraççı | Vade   | Menkul | Nominal | Faiz         | Nominal               | Birim       | Satın       | İç Repo                   | Günlük                 |   | Toplam           | Grup   | Toplam        |
|-----------------------|---------|--------|--------|---------|--------------|-----------------------|-------------|-------------|---------------------------|------------------------|---|------------------|--------|---------------|
| Kıymet                | Kurum   | Tarihi | Tanımı | Oranı   | Ödeme Sayısı | Deger/ Kontrat Sayısı | Alış Fiyatı | Alış Tarihi | İskonto minat Oranı Tutar | Birim Günlük Deger Kur |   | Deger            | (%)    | (%)           |
| <b>A.HİSSE SENEDİ</b> |         |        |        |         |              |                       |             |             |                           |                        |   |                  |        |               |
|                       | T.C.    |        | AKBNK  |         |              | 1.250,00              | 6,802       | 02.11.2018  |                           | 6,860                  | 1 | 8.575,00         | 14,78% | 3,45%         |
|                       | T.C.    |        | ARCLK  |         |              | 49,00                 | 14,204      | 17.07.2018  |                           | 15,790                 | 1 | 773,71           | 1,33%  | 0,31%         |
|                       | T.C.    |        | BIMAS  |         |              | 53,00                 | 73,318      | 02.11.2018  |                           | 87,000                 | 1 | 4.611,00         | 7,95%  | 1,86%         |
|                       | T.C.    |        | EKGYO  |         |              | 295,00                | 2,033       | 06.07.2018  |                           | 1,500                  | 1 | 442,50           | 0,76%  | 0,18%         |
|                       | T.C.    |        | ENJSA  |         |              | 385,00                | 5,473       | 12.10.2018  |                           | 5,100                  | 1 | 1.963,50         | 3,38%  | 0,79%         |
|                       | T.C.    |        | ENKAI  |         |              | 10,87                 | 4,913       | 28.05.2018  |                           | 4,580                  | 1 | 49,78            | 0,09%  | 0,02%         |
|                       | T.C.    |        | EREGL  |         |              | 605,00                | 9,775       | 13.12.2018  |                           | 7,220                  | 1 | 4.368,10         | 7,53%  | 1,76%         |
|                       | T.C.    |        | GARAN  |         |              | 1.250,00              | 7,258       | 02.11.2018  |                           | 7,960                  | 1 | 9.950,00         | 17,15% | 4,00%         |
|                       | T.C.    |        | ISCTR  |         |              | 460,00                | 5,092       | 02.11.2018  |                           | 4,530                  | 1 | 2.083,80         | 3,59%  | 0,84%         |
|                       | T.C.    |        | KCHOL  |         |              | 195,00                | 14,423      | 13.12.2018  |                           | 14,200                 | 1 | 2.769,00         | 4,77%  | 1,11%         |
|                       | T.C.    |        | PETKM  |         |              | 234,50                | 5,076       | 02.11.2018  |                           | 5,040                  | 1 | 1.181,88         | 2,04%  | 0,48%         |
|                       | T.C.    |        | SAHOL  |         |              | 261,00                | 8,202       | 31.10.2018  |                           | 7,520                  | 1 | 1.962,72         | 3,38%  | 0,79%         |
|                       | T.C.    |        | SISE   |         |              | 260,00                | 5,092       | 02.11.2018  |                           | 5,670                  | 1 | 1.474,20         | 2,54%  | 0,59%         |
|                       | T.C.    |        | TCELL  |         |              | 348,00                | 11,161      | 02.11.2018  |                           | 12,170                 | 1 | 4.235,16         | 7,30%  | 1,70%         |
|                       | T.C.    |        | THYAO  |         |              | 334,00                | 16,107      | 31.10.2018  |                           | 16,110                 | 1 | 5.380,74         | 9,28%  | 2,17%         |
|                       | T.C.    |        | TOASO  |         |              | 38,00                 | 23,581      | 12.10.2018  |                           | 16,900                 | 1 | 642,20           | 1,11%  | 0,26%         |
|                       | T.C.    |        | TSKB   |         |              | 875,00                | 1,059       | 12.06.2018  |                           | 0,810                  | 1 | 708,75           | 1,22%  | 0,29%         |
|                       | T.C.    |        | TTKOM  |         |              | 62,00                 | 5,329       | 21.06.2018  |                           | 3,900                  | 1 | 241,80           | 0,42%  | 0,10%         |
|                       | T.C.    |        | TUPRS  |         |              | 40,00                 | 114,528     | 02.11.2018  |                           | 116,700                | 1 | 4.668,00         | 8,05%  | 1,88%         |
|                       | T.C.    |        | VAKBN  |         |              | 195,00                | 4,360       | 05.10.2018  |                           | 3,900                  | 1 | 760,50           | 1,31%  | 0,31%         |
|                       | T.C.    |        | YKBNK  |         |              | 727,73                | 2,174       | 05.10.2018  |                           | 1,600                  | 1 | 1.164,37         | 2,01%  | 0,47%         |
| <b>GRUP TOPLAMI</b>   |         |        |        |         |              | <b>7.928,10</b>       |             |             |                           |                        |   | <b>58.006,71</b> |        | <b>23,35%</b> |

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

**31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU**

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

| Menkul                       | İhraççı | Vade       | Menkul       | Nominal    | Faiz         | Nominal               | Birim       | Satın       | İç Repo             | Günlük             |     |                   |          |               |
|------------------------------|---------|------------|--------------|------------|--------------|-----------------------|-------------|-------------|---------------------|--------------------|-----|-------------------|----------|---------------|
| Kıymet                       | Kurum   | Tarihi     | Tanımı       | Faiz Oranı | Ödeme Sayısı | Deger/ Kontrat Sayısı | Alış Fiyatı | Alış Tarihi | İskonto minat Oranı | Birim Günlük Deger | Kur | Toplam Deger      | Grup (%) | Toplam (%)    |
| <b>DEVLET TAHVİLİ</b>        |         |            |              |            |              |                       |             |             |                     |                    |     |                   |          |               |
|                              | T.C.    | 05.02.2020 | TRT050220T17 | 3,70%      | 6            | 15.000,00             | 86,972      | 14.11.2018  | 12,48%              | 91,194             | 1   | 13.679,08         | 7,93%    | 5,51%         |
|                              | T.C.    | 12.06.2019 | TRT120619T17 | 0,00%      | 0            | 50.000,00             | 87,037      | 14.11.2018  | 21,96%              | 91,616             | 1   | 45.807,81         | 26,57%   | 18,44%        |
|                              | T.C.    | 13.11.2019 | TRT131119T19 | 6,50%      | 6            | 35.000,00             | 94,095      | 19.12.2018  | 12,42%              | 96,267             | 1   | 33.693,60         | 19,54%   | 13,56%        |
|                              | T.C.    | 15.05.2019 | TRT150519T15 | 5,55%      | 6            | 44.000,00             | 97,359      | 08.11.2018  | 22,60%              | 97,996             | 1   | 43.118,40         | 25,01%   | 17,36%        |
|                              | T.C.    | 27.03.2019 | TRT270319T13 | 5,20%      | 6            | 36.000,00             | 97,714      | 29.11.2018  | 22,96%              | 100,313            | 1   | 36.112,52         | 20,95%   | 14,54%        |
| <b>ARA GRUP TOPLAMI</b>      |         |            |              |            |              | <b>180.000,00</b>     |             |             |                     |                    |     | <b>172.411,41</b> |          | <b>69,40%</b> |
| <b>GRUP TOPLAMI</b>          |         |            |              |            |              | <b>180.000,00</b>     |             |             |                     |                    |     | <b>172.411,41</b> |          | <b>69,40%</b> |
| <b>K.BORSA PARA PİYASASI</b> |         |            |              |            |              |                       |             |             |                     |                    |     |                   |          |               |
|                              |         | 02.01.2019 |              | 23,80%     |              | 18.023,47             | 100         | 31.12.2018  | 0,00%               | 100,130            | 1   | 18.023,47         | 100,00%  | 7,25%         |
| <b>GRUP TOPLAMI</b>          |         |            |              |            |              | <b>18.023,47</b>      |             |             |                     |                    |     | <b>18.023,47</b>  |          | <b>7,25%</b>  |
| <b>FON PORTFÖY DEĞERİ</b>    |         |            |              |            |              | <b>205.951,57</b>     |             |             |                     |                    |     | <b>248.441,59</b> |          | <b>98,64</b>  |

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**  
**OKS DENGELİ 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<br>TL    | Grup<br>% | Toplam<br>%    |
| <b>A.FON PORTFÖY DEĞERİ</b>             | <b>248.442</b> | -         | <b>98,64%</b>  |
| <b>B.HAZIR DEĞERLER</b>                 | <b>441</b>     | -         | <b>0,18%</b>   |
| b) Bankalar                             | 441            | 100,00%   | 0,18%          |
| i) TL Hesaplar                          | 441            | 100,00%   | 0,18%          |
| ii) Yabancı Para TL Karşılığı           | -              | -         | -              |
| iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları) | -              | -         | -              |
| c) Diğer Hazır Değerler                 | -              | -         | -              |
| <b>C.ALACAKLAR</b>                      | <b>4.905</b>   | -         | <b>1,94%</b>   |
| a) Takastan Alacaklar T1                | -              | -         | -              |
| b) Takastan Alacaklar T2                | -              | -         | -              |
| c) Takastan BPP Alacakları              | 4.905          | 100,00%   | 1,94%          |
| d) Diğer Alacaklar                      | -              | -         | -              |
| <b>D.DİĞER VARLIKLAR</b>                | <b>0</b>       | -         | <b>0,00%</b>   |
| <b>E.BORÇLAR</b>                        | <b>1.917</b>   | -         | <b>-0,76%</b>  |
| a) Takasa Borçlar T1                    | -              | -         | -              |
| b) Takasa Borçlar T2                    | -              | -         | -              |
| c) Yönetim Ücreti                       | 172            | 8,99%     | -0,07%         |
| d) Ödenecek Vergi                       | -              | -         | -              |
| e) İhtiyatlar                           | -              | -         | -              |
| f) Krediler                             | -              | -         | -              |
| g) Diğer Borçlar                        | 1.745          | 91,01%    | -0,69%         |
| i) Denetim Ücreti                       | 800            | 41,70%    | -0,32%         |
| ii) Ödenecek Saklama Komisyonu          | 113            | 5,89%     | -0,04%         |
| iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti     | 9              | 0,45%     | 0,00%          |
| iv) Noter masrafı                       | -              | -         | -              |
| v) İlan giderleri                       | -              | -         | -              |
| vi) Karşılıklar                         | -              | -         | -              |
| vii) Diğer                              | 824            | 42,97%    | -0,33%         |
| <b>M.D.Düşüş Karşılığı</b>              | <b>0</b>       | -         | <b>0,00%</b>   |
| <b>FON TOPLAM DEĞERİ</b>                | <b>251.870</b> |           | <b>100,00%</b> |
| Fon toplam değeri (TL)                  | 251.870        |           |                |
| Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)           | 23.499.011     |           |                |
| Birim pay değeri (TL)                   | 0,010718       |           |                |