

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş
OKS AGRESİF KATILIM 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



**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF KATILIM 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 Agresif Katılım 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 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Katılım 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.

Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 20 Nisan 2021

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

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-2
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	3

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş OKS AGRESİF KATILIM 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 Tanıma	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
	T.C.	-	ALBRK	-	-	25.000,00	1,50000	18.08.2020	-	-	1,94	1,00	48.500,00	9,74	2,86
	T.C.	-	ARZUM	-	-	186,00	17,00000	23.12.2020	-	-	24,62	1,00	4.579,32	0,92	0,27
	T.C.	-	BIMAS	-	-	600,00	65,10000	18.08.2020	-	-	75,50	1,00	45.300,00	9,10	2,67
	T.C.	-	BLCYT	-	-	9.000,00	2,78885	01.09.2020	-	-	6,64	1,00	59.760,00	12,00	3,52
	T.C.	-	EGSER	-	-	3.000,00	2,82000	17.07.2020	-	-	10,29	1,00	30.870,00	6,20	1,82
	T.C.	-	EKGYO	-	-	20.000,00	1,67000	03.11.2020	-	-	2,14	1,00	42.800,00	8,60	2,52
	T.C.	-	EREGL	-	-	3.500,00	6,98714	19.03.2020	-	-	14,93	1,00	52.255,00	10,50	3,08
	T.C.	-	ISDMR	-	-	2.500,00	6,67000	07.08.2020	-	-	10,11	1,00	25.275,00	5,08	1,49
	T.C.	-	KRVGD	-	-	800,00	9,00000	16.12.2020	-	-	13,22	1,00	10.576,00	2,12	0,62
	T.C.	-	MAVI	-	-	700,00	35,41143	19.03.2020	-	-	52,20	1,00	36.540,00	7,34	2,16
	T.C.	-	THYAO	-	-	3.000,00	10,54000	20.10.2020	-	-	12,91	1,00	38.730,00	7,78	2,28
	T.C.	-	ULUSE	-	-	2.000,00	50,29165	04.11.2020	-	-	51,35	1,00	102.700,00	20,63	6,06
GRUP TOPLAMI						70.286,00							497.885,32		29,36

KİRA SERTİFİKALARI

T.C. 17.09.2025	TRD170925T19	0,95	6	90.000,00	100,00000	23.09.2020	-	-	107,04	1,00	96.332,58	9,76	5,68
AKTİF BANK SUKUK VARLIK KİRALAMA A.Ş. 12.02.2021	TRDABVK22115	4,30	6	100.000,00	100,39614	18.12.2020	18,59	-	102,41	1,00	102.412,61	10,37	6,04
Bereket Varlık Kiralama A.Ş. 12.02.2021	TRDBRKT22147	3,38	3	80.000,00	100,00000	25.12.2020	16,91	-	101,66	1,00	81.331,03	8,24	4,80
Bereket Varlık Kiralama A.Ş. 23.02.2021	TRDBRKT22162	3,76	12	50.000,00	100,00000	04.12.2020	18,10	-	101,42	1,00	50.711,83	5,14	2,99
Halk Yatırım Menkul Değerler A.Ş. 23.03.2021	TRDHVKA32152	5,12	12	50.000,00	100,00000	30.12.2020	19,33	-	101,22	1,00	50.612,36	5,13	2,99
T.C. 02.02.2021	TRDYVKS22119	6,90	6	30.000,00	100,00000	06.08.2020	14,50	-	105,76	1,00	31.728,12	3,21	1,87
YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş. 07.04.2021	TRDYVKS42117	9,05	6	100.000,00	100,00000	23.10.2020	20,99	-	103,88	1,00	103.883,59	10,52	6,13
YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş. 02.06.2021	TRDYVKS62115	3,28	3	60.000,00	100,00000	03.06.2020	2,04	-	102,43	1,00	61.459,72	6,23	3,62
YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş. 24.12.2021	TRDYVKS2119	4,14	3	100.000,00	101,41074	27.01.2020	3,16	-	101,04	1,00	101.043,82	10,24	5,96
YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş. 12.10.2022	TRDYVKSE2214	4,26	3	40.000,00	100,00000	14.10.2020	0,22	-	103,85	1,00	41.540,16	4,21	2,45

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş OKS AGRESİF KATILIM 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		Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutarı	Birim Deger	Günlük Kur	Deger	(%)	(%)
	Ziraat Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	06.01.2021	TRDZKVK12114	3,47	3	110.000,00	100,50957	12.11.2020	13,21	-	103,40	1,00	113.741,62	11,52	6,71
	Ziraat Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	24.02.2021	TRDZKVK22139	4,00	12	150.000,00	100,06593	07.12.2020	18,18	-	101,60	1,00	152.401,28	15,44	8,99
GRUP TOPLAMI						960.000,00							987.198,70		58,22
KATILIM HESABI															
	Ziraat Katılım Bankası	01.02.2021	KH.28/12/2020.ZKB.35G	17,70	-	55.000,00	100,00000	28.12.2020	-	-	100,34	1,00	55.186,70	100,00	3,25
GRUP TOPLAMI						55.000,00							55.186,70		3,25
KATILMA BELGELERİ															
	-	-	PYT	-	-	61.635,00	1,05460	28.12.2020	-	-	1,23	1,00	75.673,30	48,73	4,46
	-	-	RP8	-	-	39.000,00	1,44771	25.12.2020	-	-	2,04	1,00	79.610,90	51,27	4,70
GRUP TOPLAMI						100.635,00							155.284,19		9,16
FON PORTFÖY DEĞERİ						1.185.921,00							1.695.554,91		100,00
DÖVİZ BAKİYELERİ															
	-	-	TRY	-	-	24.708,93	1,00000	31.12.2020	-	-	1,00	1,00	24.708,93	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						24.708,93							24.708,93		

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN
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		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	1.695.555	-	-
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	24.709	-	1,44
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	24.709	100,00	1,44
i) TL Hesaplar	24.709	100,00	1,44
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	5.826	-	0,33
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	5.826	100,00	0,33
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	13.354	-	(0,78)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	1.326	9,93	(0,08)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	12.028	90,07	(0,70)
i)Denetim Ücreti	965	7,22	(0,06)
ii)Ödenecek Saklama Komisyonu	36	0,27	-
iii)Ödenecek SPK kayda alma ücreti	53	0,40	-
iv)Noter Masrafı	0	-	-
v)İlan Giderleri	0	-	-
vi)Karşılıklar	8.335	62,42	(0,49)
vii)Diğer	2.639	19,76	(0,15)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	1.712.736		100%
Fon toplam değeri (TL)	1.712.736		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	91.589.722		
Birim pay değeri (TL)	0,018700		