

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

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

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük			Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Deger	(%)	(%)
	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger			
HİSSE SENETLERİ																
	T.C.	-	AKBNK	-	-	9.850,50	6,04642	31.12.2020	-	-	6,93	1,00	68.263,97	4,70	3,28	
	T.C.	-	ALCTL	-	-	465,00	26,86628	23.12.2020	-	-	29,66	1,00	13.791,90	0,95	0,66	
	T.C.	-	ALKIM	-	-	1.000,00	13,52315	31.12.2020	-	-	14,90	1,00	14.900,00	1,03	0,72	
	T.C.	-	ARCLK	-	-	1.360,00	23,33039	29.12.2020	-	-	30,40	1,00	41.344,00	2,85	1,98	
	T.C.	-	ARDYZ	-	-	290,00	33,95391	23.12.2020	-	-	48,08	1,00	13.943,20	0,96	0,67	
	T.C.	-	ASELS	-	-	1.900,00	16,64775	29.12.2020	-	-	18,25	1,00	34.675,00	2,39	1,66	
	T.C.	-	BIMAS	-	-	1.730,00	62,88806	31.12.2020	-	-	75,50	1,00	130.615,00	8,99	6,27	
	T.C.	-	CCOLA	-	-	440,00	60,16364	29.12.2020	-	-	65,80	1,00	28.952,00	1,99	1,39	
	T.C.	-	DOHOL	-	-	8.900,00	2,49414	29.12.2020	-	-	3,07	1,00	27.323,00	1,88	1,31	
	T.C.	-	EREGL	-	-	7.025,00	9,63562	31.12.2020	-	-	14,93	1,00	104.883,25	7,22	5,03	
	T.C.	-	FONET	-	-	1.100,00	11,27909	23.12.2020	-	-	13,03	1,00	14.333,00	0,99	0,69	
	T.C.	-	FROTO	-	-	50,00	87,95561	23.12.2020	-	-	126,00	1,00	6.300,00	0,43	0,30	
	T.C.	-	GARAN	-	-	13.625,00	8,10096	31.12.2020	-	-	10,37	1,00	141.291,25	9,72	6,78	
	T.C.	-	ISCTR	-	-	9.450,00	5,69501	31.12.2020	-	-	7,00	1,00	66.150,00	4,55	3,17	
	T.C.	-	KAREL	-	-	1.000,00	17,49200	24.11.2020	-	-	23,06	1,00	23.060,00	1,59	1,11	
	T.C.	-	KCHOL	-	-	3.175,00	16,97123	31.12.2020	-	-	21,12	1,00	67.056,00	4,61	3,22	
	T.C.	-	KOZAL	-	-	250,00	78,42972	23.12.2020	-	-	96,70	1,00	24.175,00	1,66	1,16	
	T.C.	-	KRDMD	-	-	7.575,00	4,91515	29.12.2020	-	-	5,78	1,00	43.783,50	3,01	2,10	
	T.C.	-	SAHOL	-	-	4.500,00	10,39128	29.12.2020	-	-	11,46	1,00	51.570,00	3,55	2,48	
	T.C.	-	SISE	-	-	12.800,42	6,04519	31.12.2020	-	-	7,31	1,00	93.571,07	6,44	4,49	
	T.C.	-	SOKM	-	-	1.050,00	11,77216	29.12.2020	-	-	12,62	1,00	13.251,00	0,91	0,64	
	T.C.	-	TAVHL	-	-	1.700,00	17,35939	31.12.2020	-	-	21,30	1,00	36.210,00	2,49	1,74	
	T.C.	-	TCELL	-	-	5.800,00	15,32735	31.12.2020	-	-	16,10	1,00	93.380,00	6,43	4,48	
	T.C.	-	TOASO	-	-	1.050,00	22,24428	23.12.2020	-	-	33,92	1,00	35.616,00	2,45	1,71	
	T.C.	-	TUPRS	-	-	585,00	93,22009	31.12.2020	-	-	108,00	1,00	63.180,00	4,35	3,03	
	T.C.	-	TURSG	-	-	4.325,00	6,00347	29.12.2020	-	-	6,60	1,00	28.545,00	1,96	1,37	
	T.C.	-	VAKBN	-	-	12.325,00	4,80678	31.12.2020	-	-	4,71	1,00	58.050,75	3,99	2,79	
	T.C.	-	VESBE	-	-	375,00	30,56133	29.12.2020	-	-	40,88	1,00	15.330,00	1,05	0,74	
	T.C.	-	VESTL	-	-	1.000,00	17,47087	31.12.2020	-	-	21,06	1,00	21.060,00	1,45	1,01	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS AGRESİF 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.C.	-	YATAS	-	-	2.075,00	7,89912	29.12.2020	-	-	14,45	1,00	29.983,75	2,06	1,44
	T.C.	-	YKBNK	-	-	15.750,92	2,55826	29.12.2020	-	-	3,08	1,00	48.512,83	3,34	2,33
GRUP TOPLAMI						132.521,84							1.453.100,47		69,74
BANKA BONOSU															
	ALTERNATİF BANK	04.03.2021	TRFALNF32123	-	-	30.000,00	95,90700	01.12.2020	17,83	-	97,38	1,00	29.214,99	15,31	1,40
	Türk Ekonomi Bankası	05.03.2021	TRFTEBK32115	2,35	3	30.000,00	100,00000	05.06.2020	19,83	-	99,35	1,00	29.805,52	15,62	1,43
	Türk Ekonomi Bankası	12.03.2021	TRFTEBK32123	2,35	3	30.000,00	100,00000	12.06.2020	9,76	-	100,61	1,00	30.184,35	15,82	1,45
	TÜRKİYE İŞ BANKASI	07.01.2021	TRFTISB12129	-	-	40.000,00	96,81800	06.10.2020	13,55	-	99,90	1,00	39.958,24	20,94	1,92
	Yapı ve Kredi Bankası	15.01.2021	TRFYKBK12122	-	-	30.000,00	95,42900	10.07.2020	15,97	-	99,55	1,00	29.866,31	15,65	1,43
ARA GRUP TOPLAMI						160.000,00							159.029,42		7,63
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.MERKEZ BANKASI	21.04.2021	TRT210421T14	10,45	6	30.000,00	118,19368	07.02.2020	15,49	-	105,88	1,00	31.765,19	16,65	1,52
ARA GRUP TOPLAMI						30.000,00							31.765,19		1,52
GRUP TOPLAMI						190.000,00							190.794,61		9,16
KATILMA BELGESİ															
	-	-	GLDTR	-	-	975	26,564308	22.07.2020	-	-	39,96	1,00	38.961,00	100,00	1,87
GRUP TOPLAMI						975,00							38.961,00		1,87
TERS REPO															
	T.C.	04.01.2021	TRT160425T33	11,00	-	200.241,10	0,99135	31.12.2020		201.745,00	99,25	1,00	200.241,10	100,00	9,61
GRUP TOPLAMI						200.241,10				201.745,00			200.241,10		9,61

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS AGRESİF 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	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutarı	Deger				
TPP	-	04.01.2021	-	18,05	-	200.395,62	100,00000	31.12.2020	-	-	100,20	1,00	200.395,62	100,00	9,62
GRUP TOPLAMI						200.395,62							200.395,62		9,62
FON PORTFÖY DEĞERİ						724.133,56				201.745,00			2.083.492,79		100,00
DÖVİZ BAKİYELERİ	-	-	TRY	-	-	7.749,10	1,00000	31.12.2020	-	-	1,00	1,00	7.749,10	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						7.749,10							7.749,10		0,00

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS AGRESİF 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	2.083.493	-	99,36
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	7.749	-	0,37
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	7.749	100,00	0,37
i) TL Hesaplar	7.749	100,00	0,37
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	21.104	-	1,00
a) Takastan Alacaklar T1	13.369	63,71	0,64
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	7.735	36,29	0,36
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	15.273	-	(0,73)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	1.476	9,66	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	13.797	90,34	(0,66)
i) Denetim Ücreti	965	6,32	(0,05)
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	142	0,93	-0,01
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	53	0,35	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	9.996	65,45	(0,48)
vii) Diğer	2.641	17,29	(0,13)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	2.097.074		100%
Fon toplam değeri (TL)	2.097.074		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	141.967.503		
Birim pay değeri (TL)	0,014772		