

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DİNAMİK 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 DİNAMİK 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 Dinamik 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 Dinamik 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 DİNAMİK 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 DİNAMİK 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	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Kur	Deger	(%)	(%)
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger				
HİSSE SENETLERİ															
	T.C.	-	ALBRK	-	-	20000,00	1,50000	18.08.2020	-	-	1,94	1,00	38.800,00	8,81	2,33
	T.C.	-	ARZUM	-	-	184,00	17,00000	23.12.2020	-	-	24,62	1,00	4.530,08	1,03	0,27
	T.C.	-	BIMAS	-	-	600,00	65,10000	18.08.2020	-	-	75,50	1,00	45.300,00	10,29	2,72
	T.C.	-	BLCYT	-	-	9000,00	2,93333	01.09.2020	-	-	6,64	1,00	59.760,00	13,58	3,59
	T.C.	-	EGSER	-	-	3000,00	2,82000	17.07.2020	-	-	10,29	1,00	30.870,00	7,01	1,85
	T.C.	-	EKGYO	-	-	15000,00	1,67000	03.11.2020	-	-	2,14	1,00	32.100,00	7,29	1,93
	T.C.	-	EREGL	-	-	3500,00	6,99143	19.03.2020	-	-	14,93	1,00	52.255,00	11,87	3,14
	T.C.	-	ISDMR	-	-	2500,00	6,67000	07.08.2020	-	-	10,11	1,00	25.275,00	5,74	1,52
	T.C.	-	KRVGD	-	-	800,00	9,00000	16.12.2020	-	-	13,22	1,00	10.576,00	2,40	0,63
	T.C.	-	MAVI	-	-	700,00	35,41143	19.03.2020	-	-	52,20	1,00	36.540,00	8,30	2,19
	T.C.	-	THYAO	-	-	2500,00	10,54000	20.10.2020	-	-	12,91	1,00	32.275,00	7,33	1,94
	T.C.	-	ULUSE	-	-	1400,00	49,88871	05.11.2020	-	-	51,35	1,00	71.890,00	16,33	4,31
GRUP TOPLAMI						59.184,00							440.171,08		26,42

KİRA SERTİFİKALARI

T.C.	17.09.2025	TRD170925T19	0,95	6	160.000,00	100,00000	23.09.2020	-	-	107,04	1,00	171.257,93	15,13	10,28
AKTİF BANK SUKUK VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12.02.2021	TRDABVK22115	4,30	6	120.000,00	100,22739	18.12.2020	18,59	-	102,41	1,00	122.895,13	10,86	7,38
Bereket Varlık Kiralama A.Ş.	12.02.2021	TRDBRKT22147	3,38	3	110.000,00	100,00000	27.11.2020	16,91	-	101,66	1,00	111.830,16	9,88	6,71
Bereket Varlık Kiralama A.Ş.	23.02.2021	TRDBRKT22162	3,76	12	80.000,00	100,00000	04.12.2020	18,10	-	101,42	1,00	81.138,93	7,17	4,87
Halk Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	23.03.2021	TRDHVKA32152	5,12	12	100.000,00	100,00000	18.11.2020	19,33	-	101,22	1,00	101.224,71	8,94	6,08
T.C.	02.02.2021	TRDYVKS22119	6,90	6	20.000,00	100,00000	06.08.2020	14,50	-	105,76	1,00	21.152,08	1,87	1,27
YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	07.04.2021	TRDYVKS42117	9,05	6	70.000,00	100,00000	23.10.2020	20,99	-	103,88	1,00	72.718,51	6,42	4,36
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	5,43	3,69
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	8,93	6,06
YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12.10.2022	TRDYVKSE2214	4,26	3	50.000,00	100,00000	14.10.2020	0,22	-	103,85	1,00	51.925,19	4,59	3,12

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.OKS DİNAMİK 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	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	Kur	Deger	(%)	(%)
	Ziraat Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	06.01.2021	TRDZKVK12114	3,47	3	100.000,00	100,44804	12.11.2020	13,21	-	103,40	1,00	103.401,47	9,13	6,21
	Ziraat Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	24.02.2021	TRDZKVK22139	4,00	12	130.000,00	100,00000	18.11.2020	18,18	-	101,60	1,00	132.081,11	11,67	7,93
GRUP TOPLAMI						1.100.000,00							1.132.128,76		67,95
KATILMA BELGESİ															
	-	-	RP8	-	-	14.000,00	0,997181	11.03.2020	-	-	2,04	1,00	28.578,27	100,00	1,72
GRUP TOPLAMI						14.000,00							28.578,27		1,72
KATILIM HESABI															
	Ziraat Katılım Bankası	01.02.2021	KH.28/12/2020.ZKB.35G	17,7	-	65.000,00	100,00000	28.12.2020	-	-	100,34	1,00	65.220,64	100,00	3,91
GRUP TOPLAMI						14.000,00							65.220,64		3,91
FON PORTFÖY DEĞERİ						1.238.184,00							1.666.098,75		100,00
DÖVİZ BAKİVELERİ															
	-	-	TRY	-	-	4.276,05	1,00000	31.12.2020	-	-	1,00	1,00	4.276,05	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						4.276,05							4.276,05		0,00

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.OKS DİNAMİK 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	1.666.099	-	100,22
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B,HAZIR DEĞERLER	4.276	-	0,26
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	4.276	100,00	0,26
i) TL Hesaplar	4.276	100,00	0,26
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	5.760	-	0,34
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	5.760	100,00	0,34
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E,BORÇLAR	13.534	-	(0,81)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	1.307	9,65	(0,08)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	12.228	90,35	(0,74)
i)Denetim Ücreti	965	7,13	(0,06)
ii)Ödenecek Saklama Komisyonu	30	0,22	-
iii)Ödenecek SPK kayda alma ücreti	54	0,40	-
iv)Noter Masrafı	-	-	-
v)İlan Giderleri	-	-	-
vi)Karşılıklar	8.543	63,12	(0,51)
vii)Diğer	2.635	19,47	(0,16)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	1.662.601		100%
Fon toplam değeri (TL)	1.662.601		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	90.418.848		
Birim pay değeri (TL)	0,018388		