

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ 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 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 2020 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.

Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 20 Nisan 2021

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS DENGELİ 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 DENGELİ 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	Kur	Deger	(%)	(%)
	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur				
HİSSE SENETLERİ																
	T.C.	-	AKBNK	-	-	5.500,00	6,29000	14.12.2020	-	-	6,93	1,00		38.115,00	10,17	2,69
	T.C.	-	ARDYZ	-	-	375,00	39,38000	11.12.2020	-	-	48,08	1,00		18.030,00	4,81	1,27
	T.C.	-	BIMAS	-	-	375,00	69,10000	14.12.2020	-	-	75,50	1,00		28.312,50	7,56	2,00
	T.C.	-	EREGL	-	-	1.900,00	11,65737	14.12.2020	-	-	14,93	1,00		28.367,00	7,57	2,00
	T.C.	-	GARAN	-	-	5.500,00	9,38000	14.12.2020	-	-	10,37	1,00		57.035,00	15,23	4,03
	T.C.	-	ISCTR	-	-	2.600,00	6,60000	14.12.2020	-	-	7,00	1,00		18.200,00	4,86	1,28
	T.C.	-	KCHOL	-	-	925,00	14,73672	14.12.2020	-	-	21,12	1,00		19.536,00	5,22	1,38
	T.C.	-	KOZAL	-	-	110,00	78,50000	14.12.2020	-	-	96,70	1,00		10.637,00	2,84	0,75
	T.C.	-	KRDMD	-	-	1.650,00	4,36000	14.12.2020	-	-	5,78	1,00		9.537,00	2,55	0,67
	T.C.	-	PETKM	-	-	1.800,00	4,10500	14.12.2020	-	-	4,98	1,00		8.964,00	2,39	0,63
	T.C.	-	SAHOL	-	-	1.650,00	9,11508	14.12.2020	-	-	11,46	1,00		18.909,00	5,05	1,33
	T.C.	-	SISE	-	-	2.400,00	7,25000	14.12.2020	-	-	7,31	1,00		17.544,00	4,68	1,24
	T.C.	-	TCELL	-	-	2.250,00	15,69844	14.12.2020	-	-	16,10	1,00		36.225,00	9,67	2,56
	T.C.	-	THYAO	-	-	1.400,00	12,32000	14.12.2020	-	-	12,91	1,00		18.074,00	4,82	1,28
	T.C.	-	TKFEN	-	-	1.050,00	15,43167	14.12.2020	-	-	16,59	1,00		17.419,50	4,65	1,23
	T.C.	-	TUPRS	-	-	275,00	96,30000	14.12.2020	-	-	108,00	1,00		29.700,00	7,93	2,10
GRUP TOPLAMI						29.760,00								374.605,00		26,44
BANKA BONOSU																
	ALTERNATİF BANK	04.03.2021	TRFALNF32123	-	-	30.000,00	95,90700	01.12.2020	17,83	-	97,38331	1,00		29.214,99	4,82	2,06
	Nurol Bank	23.02.2021	TRFNURL22127	-	-	30.000,00	95,79900	18.11.2020	17,53	-	97,81203	1,00		29.343,61	4,84	2,07
	Türk Ekonomi Bankası	26.02.2021	TRFTEBK22140	-	-	30.000,00	94,08600	02.07.2020	18,26	-	97,59397	1,00		29.278,19	4,83	2,07
	Yapı ve Kredi Bankası	19.02.2021	TRFYKBK22121	-	-	25.000,00	94,47000	03.07.2020	9,44	-	98,86998	1,00		24.717,50	4,08	1,74
ARA GRUP TOPLAMI						115.000,00								112.554,29		7,95

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS DENGELİ 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	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
FİNANSMAN BONOSU															
	DENİZ FAKTORİNG	29.01.2021	TRFDZFK12125	-	-	30.000,00	96,78400	13.11.2020	16,76	-	98,94	1,00	29.683,29	4,90	2,10
	QNB Finansal Kiralama A.Ş.	16.02.2021	TRFFFFR22126	-	-	40.000,00	96,16400	17.11.2020	16,98	-	98,17	1,00	39.267,69	6,48	2,77
	T.C.	09.03.2021	TRFISFN32113	-	-	30.000,00	95,94300	09.12.2020	18,29	-	97,10	1,00	29.129,34	4,81	2,06
	Oyak Yatırım	26.02.2021	TRFOYMD22117	-	-	30.000,00	96,14100	27.11.2020	17,09	-	97,73	1,00	29.320,39	4,84	2,07
	Oyak Yatırım	23.03.2021	TRFOYMD32116	-	-	30.000,00	95,53000	14.12.2020	18,36	-	96,46	1,00	28.938,35	4,78	2,04
	T.C.	10.03.2021	TRFYKYM32110	-	-	30.000,00	95,86500	09.12.2020	18,46	-	97,03	1,00	29.108,60	4,81	2,05
	T.C.	28.05.2021	TRSERGL52117	6,72	3	20.000,00	100,06880	01.06.2020	12,88	-	101,74	1,00	20.348,24	3,36	1,44
ARA GRUP TOPLAMI						210.000,00							205.795,90		14,53
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.	14.04.2021	TRT140421T13	-	-	190.000,00	88,741284	16.01.2020	15,60	-	96,10655	1,00	182.602,45	30,15	12,89
	T.C.	17.02.2021	TRT170221T12	5,35	6	50.000,00	101,10468	02.11.2020	15,07	-	103,582228	1,00	51.791,11	8,55	3,66
	T.C.MERKEZ BANKASI	21.04.2021	TRT210421T14	10,45	6	50.000,00	111,400971	26.11.2020	15,49	-	105,883983	1,00	52.941,99	8,74	3,74
ARA GRUP TOPLAMI						290.000,00							287.335,55		20,28
GRUP TOPLAMI						615.000,00							605.685,74		42,75
KATILMA BELGESİ															
	-	-	TPL	-	-	11.622,00	2,581212	18.09.2020	-	-	2,626264	1,00	30.522,44	100,00	2,15
GRUP TOPLAMI						11.622,00							30.522,44		2,15
TPP															
	-	04.01.2021	-	18,05	-	126.249,24	100,00000	31.12.2020	-	-	100,197808	1,00	126.249,24	100,00	8,91
GRUP TOPLAMI						126.249,24							126.249,24		8,91

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS DENGELİ 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	Tutarı	Deger				
TEMİNAT İŞLEMLERİ															
	-	-	Teminat	-	-	279.597,30	1,00000	31.12.2020	-	-	1,00	1,00	279.597,30	100,00	19,74
GRUP TOPLAMI						279.597,30							279.597,30		19,74
FON PORTFÖY DEĞERİ						1.062.228,54							1.416.659,72		100,00
DÖVİZ BAKİVELERİ															
			TRY			1.659,79	1,00000	31.12.2020			1,00	1,00	1.659,79	100,00	-
GRUP TOPLAMI						1.659,79							1.659,79		-
VOB SÖZLEŞMELERİ															
	Uzun	26.02.2021	XU0300221 (LONG)	-	-	7,00	1595	24.12.2020	-	-	1.658,50	1,00	-	100,00	-
GRUP TOPLAMI						7,00							0,00		-

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS DENGELİ 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	1.416.660	-	99,35
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	1.660	-	0,12
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	1.660	100,00	0,12
i) TL Hesaplar	1.660	100,00	0,12
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	20.691	-	1,44
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	13.467	65,37	0,94
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	7.225	34,63	0,50
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	12.943	-	(0,91)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	1.082	8,36	(0,08)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	11.861	91,64	(0,83)
i) Denetim Ücreti	965	7,45	(0,07)
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	261	2,01	(0,02)
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	43	0,33	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	7.902	61,06	(0,55)
vii) Diğer	2.691	20,79	(0,19)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	1.426.068		100%
Fon toplam değeri (TL)	1.426.068		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	93.866.067		
Birim pay değeri (TL)	0,015193		