

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS STANDART 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 STANDART 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 Standart 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 Standart 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 STANDART EMEKLİLİK YATIRIM
FONU**

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-4
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	5

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS STANDART 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	-	-	98.500,00	6,71992	24.11.2020	-	-	6,93	1,00	682.605,00	5,89	0,66	
	T.C.	-	ARCLK	-	-	18.750,00	26,93440	24.11.2020	-	-	30,40	1,00	570.000,00	4,92	0,55	
	T.C.	-	ASELS	-	-	35.000,00	12,95260	24.11.2020	-	-	18,25	1,00	638.750,00	5,52	0,61	
	T.C.	-	BIMAS	-	-	9.250,00	55,68193	24.11.2020	-	-	75,50	1,00	698.375,00	6,03	0,67	
	T.C.	-	EREGL	-	-	48.500,00	8,39916	24.11.2020	-	-	14,93	1,00	724.105,00	6,25	0,70	
	T.C.	-	GARAN	-	-	68.000,00	9,15453	24.11.2020	-	-	10,37	1,00	705.160,00	6,09	0,68	
	T.C.	-	ISCTR	-	-	94.250,00	6,10406	24.11.2020	-	-	7,00	1,00	659.750,00	5,70	0,63	
	T.C.	-	KCHOL	-	-	33.000,00	17,07098	24.11.2020	-	-	21,12	1,00	696.960,00	6,02	0,67	
	T.C.	-	KRDMD	-	-	135.000,00	3,93000	24.11.2020	-	-	5,78	1,00	780.300,00	6,74	0,75	
	T.C.	-	PETKM	-	-	150.000,00	5,14000	29.12.2020	-	-	4,98	1,00	747.000,00	6,45	0,72	
	T.C.	-	SAHOL	-	-	59.750,00	9,36661	24.11.2020	-	-	11,46	1,00	684.735,00	5,91	0,66	
	T.C.	-	SISE	-	-	92.250,13	5,87837	24.11.2020	-	-	7,31	1,00	674.348,45	5,82	0,65	
	T.C.	-	TCELL	-	-	40.000,00	14,39555	24.11.2020	-	-	16,10	1,00	644.000,00	5,56	0,62	
	T.C.	-	TOASO	-	-	25.000,00	32,38084	29.12.2020	-	-	33,92	1,00	848.000,00	7,32	0,82	
	T.C.	-	TTKOM	-	-	68.000,00	6,82480	24.11.2020	-	-	8,54	1,00	580.720,00	5,01	0,56	
	T.C.	-	TUPRS	-	-	7.250,00	105,20460	24.11.2020	-	-	108,00	1,00	783.000,00	6,76	0,75	
	T.C.	-	YKBNK	-	-	150.000,00	3,08000	24.11.2020	-	-	3,08	1,00	462.000,00	3,99	0,44	
GRUP TOPLAMI						1.132.500,13							11.579.808,45		11,13	
BANKA BONOSU																
	Akbankası	20.01.2021	TRFAKBK12148	-	-	2.000.000,00	94,56900	11.06.2020	16,56	-	99,33	1,00	1.986.608,00	2,96	1,91	
	Türk Ekonomi Bankası	26.02.2021	TRFTEBK22140	-	-	1.000.000,00	94,08600	02.07.2020	18,26	-	97,59	1,00	975.939,70	1,45	0,94	
	Türk Ekonomi Bankası	05.03.2021	TRFTEBK32115	2,35	3	2.000.000,00	100,00000	05.06.2020	19,83	-	99,35	1,00	1.987.034,66	2,96	1,91	
	Türk Ekonomi Bankası	12.03.2021	TRFTEBK32123	2,35	3	2.000.000,00	100,00000	12.06.2020	9,76	-	100,61	1,00	2.012.289,80	3,00	1,93	
ARA GRUP TOPLAMI						7.000.000,00							6.961.872,16		6,69	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS STANDART 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 (%)
FİNANSMAN BONOSU															
	T.C.	25.05.2021	TRDTFVK52113	8,06	12	1.500.000,00	100,03629	18.12.2020	16,22	-	101,96	1,00	1.529.442,41	2,28	1,47
	Dünya Varlık Yönetim A.Ş.	20.09.2021	TRFDVYS92112	0,50	3	500.000,00	100,00000	21.09.2020	-	-	101,08	1,00	505.418,03	0,75	0,49
	T.C.	28.05.2021	TRSERGL52117	6,72	3	1.000.000,00	99,75000	28.08.2020	12,88	-	101,74	1,00	1.017.411,78	1,52	0,98
ARA GRUP TOPLAMI						3.000.000,00							3.052.272,22		2,93
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.	01.10.2025	TRT011025T16	6,30	6	1.000.000,00	102,20000	24.12.2020	0,77	-	102,49	1,00	1.024.871,76	1,53	0,99
	T.C.	02.03.2022	TRT020322T17	5,50	6	2.500.000,00	102,15978	19.08.2020	5,18	-	99,51	1,00	2.487.770,42	3,70	2,39
	T.C.	09.06.2021	TRT090621T18	-	0	500.000,00	92,93917	03.12.2020	16,07	-	93,83	1,00	469.145,60	0,70	0,45
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	5,25	6	2.000.000,00	95,26346	24.12.2020	1,52	-	95,24	1,00	1.904.830,61	2,84	1,83
	T.C.	12.01.2022	TRT120122T17	4,75	6	5.000.000,00	99,94923	29.01.2020	5,49	-	99,18	1,00	4.959.231,87	7,39	4,77
	T.C.	13.11.2030	TRT131130T14	5,85	6	5.000.000,00	95,83571	21.12.2020	0,92	-	96,69	1,00	4.834.695,89	7,20	4,65
	T.C.	14.04.2021	TRT140421T13	-	0	500.000,00	93,96258	06.11.2020	15,60	-	96,11	1,00	480.532,75	0,72	0,46
	T.C.	14.09.2022	TRT140922T17	4,25	6	3.000.000,00	93,88846	23.12.2020	6,24	-	94,09	1,00	2.822.773,34	4,20	2,71
	T.C.	17.08.2022	TRT170822T15	5,35	6	7.500.000,00	104,80931	19.11.2020	4,19	-	98,59	1,00	7.394.278,43	11,01	7,11
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	6,10	6	2.500.000,00	102,18695	20.11.2020	1,65	-	102,61	1,00	2.565.359,83	3,82	2,47
	T.C.MERKEZ BANKASI	20.10.2021	TRT201021T25	6,90	6	6.850.000,00	105,49368	21.02.2020	6,82	-	101,46	1,00	6.949.988,52	10,35	6,68
	T.C.MERKEZ BANKASI	21.04.2021	TRT210421T14	10,45	6	5.500.000,00	114,48967	23.12.2020	15,49	-	105,88	1,00	5.823.619,04	8,67	5,60
	T.C.	22.09.2021	TRT220921T18	4,60	6	6.000.000,00	97,55745	23.12.2020	9,13	-	98,27	1,00	5.895.944,80	8,78	5,67
	T.C.	24.02.2027	TRT240227T17	5,50	6	7.000.000,00	96,89219	23.12.2020	1,36	-	97,11	1,00	6.797.911,13	10,12	6,53
ARA GRUP TOPLAMI						54.850.000,00							54.410.953,99		52,31
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ															
	Türk Telekomünikasyon A.Ş.	20.01.2022	TRSTTLK12216	1,75	3	1.500.000,00	100	14.12.2020	0,77	-	100,94	1,00	1.514.042,30	2,25	1,46
ARA GRUP TOPLAMI						1.500.000,00							1.514.042,30		1,46

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS STANDART 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 (%)
KİRA SERTİFİKALARI															
	T.C.	10.02.2021	TRD100221T17	8,80	6	190.000,00	104,729681	03.11.2020	14,44	-	107,32	1,00	203.912,79	0,30	0,20
	Türkiye Finans Katılım Bankası	08.01.2021	TRD1FVK12117	0,76	1	1.000.000,00	99,240571	08.12.2020	20,41	-	100,55	1,00	1.005.525,90	1,50	0,97
ARA GRUP TOPLAMI						1.190.000,00							1.209.438,69		1,16
GRUP TOPLAMI						67.540.000,00							67.148.579,34		64,55
KATILMA BELGELERİ															
	-	-	AGN	-	-	700.000,00	1,50798	01.01.2020	-	-	2,09	1,00	1.465.429,00	9,02	1,41
	-	-	ALBTS.F1	-	-	1.480,00	1.148,85419	13.10.2020	-	-	1.287,10	1,00	1.904.908,00	11,73	1,83
	-	-	ALDUK.F1	-	-	1.926,00	1.100,89413	08.06.2020	-	-	1.186,90	1,00	2.285.969,40	14,08	2,20
	-	-	BGY	-	-	1.400.000,00	1,29766	01.01.2020	-	-	1,50	1,00	2.097.463,20	12,92	2,02
	-	-	GLDTR	-	-	2.960,00	40,35000	13.11.2020	-	-	39,96	1,00	118.281,60	0,73	0,11
	-	-	IAG	-	-	1.248.256,00	1,60224	26.10.2020	-	-	1,68	1,00	2.092.756,11	12,89	2,01
	-	-	IDY	-	-	50.963.204,00	0,02943	26.10.2020	-	-	0,03	1,00	1.551.880,53	9,56	1,49
	-	-	ISZ	-	-	1.200.000,00	1,11130	01.01.2020	-	-	1,42	1,00	1.703.596,80	10,49	1,64
	-	-	IYG	-	-	930.692,00	1,07447	26.10.2020	-	-	1,05	1,00	980.356,52	6,04	0,94
	-	-	OGM	-	-	418.301,00	1,07578	01.01.2020	-	-	1,34	1,00	559.463,78	3,45	0,54
	-	-	TKD	-	-	16.641.396,00	0,05408	01.01.2020	-	-	0,06	1,00	1.022.214,39	6,29	0,98
	-	-	UKA	-	-	375.000,00	1,00000	31.01.2020	-	-	1,22	1,00	456.307,88	2,81	0,44
GRUP TOPLAMI						73.883.215,00							16.238.627,21		15,61
TERS REPO															
	T.C.	04.01.2021	TRT261022T10	17,25	-	1.001.890,41	2,315967	31.12.2020	-	431.785,00	232,03	1,00	1.001.890,41	100,00	0,96
GRUP TOPLAMI						1.001.890,41				431.785,00			1.001.890,41		0,96

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS STANDART 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				
VADELİ MEVDUAT															
	Akbankası	02.04.2021	TRY Mevduat	12,50	-	1.000.000,00	100,00000	24.09.2020	-	-	103,43	1,00	1.034.329,59	12,84	0,99
	Akbankası	04.01.2021	TRY Mevduat	16,00	-	1.000.000,00	100,00000	30.11.2020	-	-	101,53	1,00	1.015.300,55	12,61	0,98
	Türkiye Garanti Bankası	01.04.2021	TRY Mevduat	12,50	-	1.865.000,00	100,00000	23.09.2020	-	-	103,47	1,00	1.929.663,19	23,96	1,86
	Türkiye Vakıflar Bankası	12.02.2021	TRY Mevduat	18,75	-	4.064.742,58	100,00000	30.12.2020	-	-	100,25	1,00	4.075.071,68	50,59	3,92
GRUP TOPLAMI						7.929.742,58							8.054.365,01		7,74
FON PORTFÖY DEĞERİ						151.487.348,12				431.785,00			104.023.270,42		100,00
DÖVİZ BAKİYELERİ															
			TRY			40.494,79	1,00000	31.12.2020			1,00	1,00	40.494,79	100,00	-
GRUP TOPLAMI						40.494,79							40.494,79		

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS STANDART 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	104.023.270	-	100,15
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	40.495	-	0,04
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	40.495	100	0,04
i) TL Hesaplar	40.495	100	0,04
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	192.173	-	(0,19)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	81.721	42,52	(0,08)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	110.452	57,48	(0,11)
i) Denetim Ücreti	2.292	1,19	-
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	511	0,27	-
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	3.333	1,73	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	101.405	52,77	(0,10)
vii) Diğer	2.911	1,51	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	103.871.592		100%
Fon toplam değeri (TL)	103.871.592		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	6.992.385.617		
Birim pay değeri (TL)	0,014855		