

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS KATILIM 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 KATILIM 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 Katılım 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 Katılım 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 KATILIM STANDART 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 KATILIM 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 Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ															
	T.C.	-	ALKIM	-	-	0,84	3,735369	13.05.2020	-	-	14,90	1,00	12,52	0,00	0,00
	T.C.	-	BLCYT	-	-	172.500,00	4,282039	01.09.2020	-	-	6,64	1,00	1.145.400,00	100,00	2,08
GRUP TOPLAMI						172.500,84							1.145.412,52		2,08
KİRA SERTİFİKALARI															
	T.C.	09.02.2022	TRD090222T19	4,89	6	12.490.000,00	100,00000	01.10.2020	3,58	-	100,92	1,00	12.604.639,64	32,87	22,88
	T.C.	10.02.2021	TRD100221T17	8,80	6	7.180.000,00	103,34596	10.12.2020	14,44	-	107,32	1,00	7.705.756,99	20,10	13,99
	T.C.	10.08.2022	TRD100822T10	5,38	6	1.010.000,00	95,99608	01.01.2020	3,71	-	99,42	1,00	1.004.123,95	2,62	1,82
	T.C.	14.07.2021	TRD140721T18	4,70	6	1.450.000,00	93,87723	02.04.2020	4,95	-	102,09	1,00	1.480.280,45	3,86	2,69
	T.C.	17.09.2025	TRD170925T19	0,95	6	4.200.000,00	100,00000	23.09.2020	-	-	107,04	1,00	4.495.520,61	11,72	8,16
	T.C.MERKEZ BANKASI	30.10.2024	TRD301024T10	1,63	6	600.000,00	100,00000	01.01.2020	-	-	124,67	1,00	748.025,77	1,95	1,36
	AKTİF BANK SUKUK VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12.02.2021	TRDABVK22115	4,30	6	100.000,00	101,57795	18.12.2020	18,59	-	102,41	1,00	102.412,61	0,27	0,19
	Bereket Varlık Kiralama A.Ş.	23.02.2021	TRDBRKT22162	3,76	12	350.000,00	100,00000	04.12.2020	18,10	-	101,42	1,00	354.982,82	0,93	0,64
	T.C.	02.02.2021	TRDYVKS22119	6,90	6	500.000,00	100,00000	06.08.2020	14,50	-	105,76	1,00	528.801,96	1,38	0,96
	YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	02.06.2021	TRDYVKS62115	3,28	3	3.200.000,00	100,27756	25.11.2020	2,04	-	102,43	1,00	3.277.851,73	8,55	5,95
	YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	24.12.2021	TRDYVKS2119	4,14	3	2.100.000,00	100,96858	05.03.2020	3,16	-	101,04	1,00	2.121.920,13	5,53	3,85
	YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.	12.10.2022	TRDYVKSE2214	4,26	3	600.000,00	100,00000	14.10.2020	0,22	-	103,85	1,00	623.102,34	1,62	1,13
	Ziraat Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	06.01.2021	TRDZKVK12114	3,47	3	1.500.000,00	101,08527	12.11.2020	13,21	-	103,40	1,00	1.551.022,08	4,04	2,82
	Ziraat Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	24.02.2021	TRDZKVK22139	4,00	12	1.720.000,00	100,01304	11.12.2020	18,18	-	101,60	1,00	1.747.534,67	4,56	3,17
GRUP TOPLAMI						37.000.000,00							38.345.975,75		69,60
KATILMA BELGELERİ															
	-	-	ELZ	-	-	1.750.000,00	1,00000	07.12.2020	-	-	1,09	1,00	1.910.480,25	18,13	3,47
	-	-	ICI	-	-	299.257,00	1,04738	01.01.2020	-	-	1,24	1,00	369.585,99	3,51	0,67
	-	-	QPERP.F1	-	-	1.525,00	1.024,65931	18.08.2020	-	-	1.274,20	1,00	1.943.155,00	18,44	3,53
	-	-	RP2	-	-	300.000,00	1,23482	01.01.2020	-	-	1,80	1,00	540.296,10	5,13	0,98
	-	-	RP6	-	-	200.000,00	1,00000	01.01.2020	-	-	2,90	1,00	580.864,00	5,51	1,05

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük				
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme		Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı		Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
	-	-	RP8	-	-		900.000,00000	0,99859	11.03.2020	-	-	2,04	1,00	1.837.174,50	17,43	3,33
	-	-	RPAVS	-	-		675,00000	1.092,38037	01.01.2020	-	-	1.577,20	1,00	1.064.610,00	10,10	1,93
	-	-	UKA	-	-		250.000,00000	1,00000	31.01.2020	-	-	1,22	1,00	304.205,25	2,89	0,55
	-	-	YD3	-	-		1.000.000,00000	1,19409	16.03.2020	-	-	1,99	1,00	1.989.885,00	18,88	3,61
GRUP TOPLAMI							4.701.457,00							10.540.256,09		19,13
KATILIM HESAPLARI																
	Ziraat Katılım Bankası	07.06.2021	KH.07/12/2020.ZKB182G	16,80	-		100.000,00	100,00000	07.12.2020	-	-	101,29	1,00	101.285,25	2,00	0,18
	Ziraat Katılım Bankası	13.01.2021	KH.13/07/2020.ZKB184G	8,20	-		100.000,00	100,00000	13.07.2020	-	-	103,93	1,00	103.931,51	2,05	0,19
	Ziraat Katılım Bankası	01.02.2021	KH.28/12/2020.ZKB.35G	17,70	-		1.100.000,00	100,00000	28.12.2020	-	-	100,34	1,00	1.103.733,97	21,81	2,00
	Ziraat Katılım Bankası	15.03.2021	KH.15/09/2020.ZKB181G	12,90	-		180.000,00	100,00000	15.09.2020	-	-	103,92	1,00	187.061,42	3,70	0,34
	Ziraat Katılım Bankası	24.02.2021	KH.25/08/2020.ZKB183G	12,90	-		180.000,00	100,00000	25.08.2020	-	-	104,67	1,00	188.397,37	3,72	0,34
	Ziraat Katılım Bankası	01.02.2021	KH.29/12/2020.ZKB.34G	17,90	-		180.000,00	100,00000	29.12.2020	-	-	100,29	1,00	180.529,64	3,57	0,33
	Ziraat Katılım Bankası	13.01.2021	KH.14/07/2020.ZKB183G	8,50	-		20.000,00	100,00000	14.07.2020	-	-	104,05	1,00	20.810,41	0,41	0,04
	Ziraat Katılım Bankası	26.04.2021	KH.26/10/2020.ZKB182G	13,70	-		20.000,00	100,00000	26.10.2020	-	-	102,63	1,00	20.525,48	0,41	0,04
	Ziraat Katılım Bankası	27.05.2021	KH.27/11/2020.ZKB181G	16,30	-		20.000,00	100,00000	27.11.2020	-	-	101,70	1,00	20.339,40	0,40	0,04
	Ziraat Katılım Bankası	01.07.2021	KH.29/12/2020.ZKB.184G	17,10	-		20.000,00	100,00000	29.12.2020	-	-	100,28	1,00	20.056,22	0,40	0,04
	Ziraat Katılım Bankası	05.05.2021	KH.02/11/2020.ZKB184G	14,00	-		200.000,00	100,00000	02.11.2020	-	-	102,42	1,00	204.832,88	4,05	0,37
	Ziraat Katılım Bankası	12.02.2021	KH.11/08/2020.ZKB185G	10,50	-		200.000,00	100,00000	11.08.2020	-	-	104,20	1,00	208.400,00	4,12	0,38
	Ziraat Katılım Bankası	20.01.2021	KH.20/07/2020.ZKB184G	8,50	-		200.000,00	100,00000	20.07.2020	-	-	103,91	1,00	207.824,66	4,11	0,38
	Ziraat Katılım Bankası	24.05.2021	KH.23/11/2020.ZKB.182G	15,80	-		200.000,00	100,00000	23.11.2020	-	-	101,82	1,00	203.636,16	4,02	0,37
	Ziraat Katılım Bankası	01.07.2021	KH.28/12/2020.ZKB.185G	17,10	-		200.000,00	100,00000	28.12.2020	-	-	100,33	1,00	200.655,89	3,96	0,36
	Ziraat Katılım Bankası	31.03.2021	KH.28/09/2020.ZKB184G	12,90	-		250.000,00	100,00000	28.09.2020	-	-	103,46	1,00	258.658,90	5,11	0,47
	Ziraat Katılım Bankası	18.01.2021	KH.14/12/2020.ZKB35G	16,80	-		270.000,00	100,00000	14.12.2020	-	-	207,47	1,00	560.178,52	11,07	1,02
	Ziraat Katılım Bankası	20.04.2021	KH.19/10/2020.ZKB183G	13,25	-		280.000,00	100,00000	19.10.2020	-	-	102,80	1,00	287.826,58	5,69	0,52
	Ziraat Katılım Bankası	14.06.2021	KH.14/12/2020.ZKB182G	16,80	-		30.000,00	100,00000	14.12.2020	-	-	235,94	1,00	70.783,36	1,40	0,13
	Ziraat Katılım Bankası	11.01.2021	KH.07/12/2020.ZKB35G	16,80	-		900.000,00	100,00000	07.12.2020	-	-	101,29	1,00	911.567,21	18,01	1,65
GRUP TOPLAMI							4.650.000,00							5.061.034,83		9,19

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS KATILIM 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				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
FON PORTFÖY DEĞERİ						46.523.957,84							55.092.679,18		100
DÖVİZ BAKİYELERİ															
			TRY			250.874,98	1,00000	31.12.2020			1,00	1,00	250.874,98	100,00	-
GRUP TOPLAMI						250.874,98							250.874,98		

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS KATILIM 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	55.092.679	-	100,38
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	250.875	-	0,46
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	250.875	100,00	0,46
i) TL Hesaplar	250.875	100,00	0,46
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	457.667	-	(0,83)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	42.306	9,24	(0,08)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	415.361	90,76	(0,76)
i) Denetim Ücreti	1.042	0,23	-
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	1.559	0,34	-
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	1.688	0,37	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	408.161	89,18	(0,74)
vii) Diğer	2.911	0,64	(0,01)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	54.885.887		100%
Fon toplam değeri (TL)	54.885.887		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	3.340.275.379		
Birim pay değeri (TL)	0,016432		