

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
HEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş.
OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 TARİHİ İTİBARIYLA
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



TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
HEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım 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

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. HEM OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun (eski adıyla “Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu”) (“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.

Fon’un 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 Türkiye 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.

Talar Gül, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 28 Nisan 2021

**TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK
YATIRIM FONU**
(eski adıyla "Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu")

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

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım 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		Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
PAY	AKBANK TAS	-	AKBNK.E	-	-		59.197,00	5,94	-	-	-	-	6,93	-	410.235,21	5,01	3,67
	AKSİGORTA	-	AKGRT.E	-	-		19.085,00	7,13	-	-	-	-	9,30	-	177.490,50	2,17	1,59
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	AKSEN.E	-	-		10.660,00	7,01	-	-	-	-	7,44	-	79.310,40	0,97	0,71
	ALARKO HOLDİNG	-	ALARK.E	-	-		0,49	2,04	-	-	-	-	8,64	-	4,23	-	-
	ARÇELİK	-	ARCLK.E	-	-		6.172,00	20,74	-	-	-	-	30,40	-	187.628,80	2,29	1,68
	ASELSAN	-	ASELS.E	-	-		17.479,00	13,73	-	-	-	-	18,25	-	318.991,75	3,90	2,85
	AYGAZ	-	AYGAZ.E	-	-		5.594,00	11,93	-	-	-	-	14,65	-	81.952,10	1,00	0,73
	BİM MAĞAZALAR	-	BIMAS.E	-	-		5.318,00	61,68	-	-	-	-	75,50	-	401.509,00	4,91	3,59
	DOĞAN HOLDİNG	-	DOHOLE	-	-		42.776,00	2,07	-	-	-	-	3,07	-	131.322,32	1,60	1,17
	EMLAK KONUT GMYO	-	EKGYO.E	-	-		31.667,00	1,61	-	-	-	-	2,14	-	67.767,38	0,83	0,61
	ENERJİSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	ENJSA.E	-	-		8.256,00	7,33	-	-	-	-	12,51	-	103.282,56	1,26	0,92
	ENKA İNŞAAT	-	ENKALE	-	-		0,24	3,99	-	-	-	-	7,37	-	1,79	-	-
	EREĞLİ DEMİR ÇELİK	-	EREGL.E	-	-		30.129,00	9,11	-	-	-	-	14,93	-	449.825,97	5,50	4,02
	FORD OTOSAN	-	FROTO.E	-	-		755,00	67,21	-	-	-	-	126,00	-	95.130,00	1,16	0,85
	T.GARANTİ BANKASI AŞ	-	GARAN.E	-	-		45.584,00	8,26	-	-	-	-	10,37	-	472.706,08	5,78	4,23
	GOOD-YEAR	-	GOODY.E	-	-		10.904,00	4,83	-	-	-	-	8,36	-	91.157,44	1,11	0,82
	T.HALK BANKASI AŞ	-	HALKB.E	-	-		10,00	5,40	-	-	-	-	5,56	-	55,60	-	-
	T.İŞ BANKASI AŞ	-	ISCTRE	-	-		34.145,00	5,59	-	-	-	-	7,00	-	239.015,00	2,92	2,14
	İŞ Y. MEN. DEĞ.	-	ISMEN.E	-	-		16.080,00	7,10	-	-	-	-	17,66	-	283.972,80	3,47	2,54
	KAREL ELEKTRONİK	-	KARELE	-	-		5.246,00	14,86	-	-	-	-	23,06	-	120.972,76	1,48	1,08
	KOÇ HOLDİNG	-	KCHOLE	-	-		23.128,00	15,19	-	-	-	-	21,12	-	488.463,36	5,97	4,37
	KOZA MADENCİLİK	-	KOZAA.E	-	-		5.420,00	11,26	-	-	-	-	15,49	-	83.955,80	1,03	0,75
	KOZA ALTIN	-	KOZALE	-	-		2.593,00	70,57	-	-	-	-	96,70	-	250.743,10	3,06	2,24
	KARDEMİR	-	KRDMD.E	-	-		19.218,00	2,66	-	-	-	-	5,78	-	111.080,04	1,36	0,99
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVLE	-	-		1.555,00	40,00	-	-	-	-	52,20	-	81.171,00	0,99	0,73
	MİGROS TİCARET	-	MGROS.E	-	-		4.878,00	30,68	-	-	-	-	42,80	-	208.778,40	2,55	1,87
	PETKİM	-	PETKM.E	-	-		27.254,40	3,27	-	-	-	-	4,98	-	135.726,91	1,66	1,21
	PEGASUS	-	PGSUS.E	-	-		3,00	66,00	-	-	-	-	74,60	-	223,80	-	-
	SABANCI HOLDİNG	-	SAHOLE	-	-		21.645,00	8,65	-	-	-	-	11,46	-	248.051,70	3,03	2,22
	ŞİŞE CAM	-	SISE.E	-	-		46.487,52	6,00	-	-	-	-	7,31	-	339.823,80	4,15	3,04

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım 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 (%)
	TURKCELL	-	TCELL.E	-	-	29.692,00	14,09	-	-	-	16,10	-	478.041,20	5,84	4,28
	TEKFEN HOLDİNG	-	TKFEN.E	-	-	6.730,00	16,67	-	-	-	16,59	-	111.650,70	1,36	1,00
	TOFAŞ OTO. FAB.	-	TOASO.E	-	-	5.566,00	21,76	-	-	-	33,92	-	188.798,72	2,31	1,69
	TSKB	-	TSKB.E	-	-	10,00	2,41	-	-	-	1,78	-	17,80	0,00	0,00
	TÜRK TELEKOM	-	TTKOM.E	-	-	27.463,00	6,79	-	-	-	8,54	-	234.534,02	2,87	2,10
	TÜPRAŞ A.Ş.	-	TUPRS.E	-	-	3.232,00	97,75	-	-	-	108,00	-	349.056,00	4,27	3,12
	TÜRKİYE SİGORTA AŞ	-	TURSG.E	-	-	44.577,00	5,75	-	-	-	6,60	-	294.208,20	3,60	2,63
	ÜLKER BİSKÜVİ	-	ULKER.E	-	-	6.460,00	22,26	-	-	-	23,14	-	149.484,40	1,83	1,34
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	-	VAKBN.E	-	-	24.155,00	4,47	-	-	-	4,71	-	113.770,05	1,39	1,02
	VESTEL	-	VESTL.E	-	-	6.954,00	15,53	-	-	-	21,06	-	146.451,24	1,79	1,31
	YATAŞ	-	YATAS.E	-	-	18.089,00	7,56	-	-	-	14,45	-	261.386,04	3,19	2,34
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	-	YKBNK.E	-	-	63.580,34	2,30	-	-	-	3,08	-	195.827,43	2,39	1,75
GRUP TOPLAMI						737.747,99							8.183.575,40	100,00	73,19
BORÇLANMA ARAÇLARI															
ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI															
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	TKYB 1.Varlık Finansmanı Fonu	07.12.2023	TRPKYVFA2318	12,32	868	100.000,00	111,84	-	12,9	-	112,77	-	112.772,25	7,61	1,01
ARA GRUP TOPLAMI						100.000,00							112.772,25	7,61	1,01
Finansman Bonosu	AKBANK TAŞ	20.01.2021	TRFAKBK12148	15,35	19	60.000,00	94,57	-	16,51	-	99,21	-	59.523,21	4,02	0,53
	TÜRK EKONOMİ BANKASI AŞ	12.03.2021	TRFTEBK32123	9,43	70	60.000,00	100,00	-	9,76	-	100,54	-	60.322,48	4,07	0,54
	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	05.03.2021	TRFYAKF32130	18,44	63	150.000,00	96,76	-	19,9	-	96,91	-	145.361,76	9,81	1,30
ARA GRUP TOPLAMI						270.000,00							265.207,45	17,90	2,37
Tahvil	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	14.09.2029	TRSVKFB92925	15,38	84	35.000,00	100,00	-	16,29	-	101,45	-	35.507,04	2,40	0,32
ARA GRUP TOPLAMI						35.000,00							35.507,04	2,40	0,32

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım 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 Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oran	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI															
Devlet Tahvili	HAZİNE	02.03.2022	TRT020322T17	15,08	396	250.000,00	106,06	-	15,64	-	99,39	-	248.479,20	16,78	2,22
	HAZİNE	14.04.2021	TRT140421T13	14,76	103	90.000,00	93,62	-	15,55	-	95,99	-	86.392,90	5,83	0,77
	HAZİNE	14.09.2022	TRT140922T17	14,27	575	60.000,00	94,42	-	14,78	-	93,99	-	56.391,35	3,81	0,50
	HAZİNE	17.02.2021	TRT170221T12	14,13	47	200.000,00	105,48	-	15,03	-	103,46	-	206.925,57	13,97	1,85
	HAZİNE	17.08.2022	TRT170822T15	14,58	537	191.000,00	98,37	-	15,11	-	98,48	-	188.089,30	12,70	1,68
	HAZİNE	18.01.2023	TRT180123T10	13,9	646	80.000,00	106,08	-	14,38	-	102,50	-	82.000,66	5,54	0,73
	HAZİNE	20.10.2021	TRT201021T25	15,63	280	100.000,00	101,39	-	16,24	-	101,33	-	101.333,90	6,84	0,91
	HAZİNE	22.09.2021	TRT220921T18	15,77	256	100.000,00	80,36	-	16,39	-	98,14	-	98.142,91	6,63	0,88
ARA GRUP TOPLAMI						1.071.000,00							1.067.755,79	72,09	9,55
GRUP TOPLAMI						1.476.000,00							1.481.242,53	100,00	13,25
DİĞER VARLIKLAR															
Borsa Para Piyasası	-	04.01.2021	-	17,75	3	666.293,56	-	31.12.2020	19,4	-	-	-	665.323,39	43,89	5,95
ARA GRUP TOPLAMI						666.293,56							665.323,39	43,89	5,95
Vadeli Mevduat	AKBANK TAS	15.01.2021	3AyaKadarVD-AKB-TRY	17	14	211.497,93	-	11.12.2020	18,37	-	17,00	-	213.557,98	14,09	1,91
	TC ZİRAAT BANKASI AŞ	15.01.2021	3AyaKadarVD-TCZ-TRY	16,5	14	221.577,93	-	11.12.2020	17,79	-	16,50	-	223.672,89	14,75	2,00
	T.HALK BANKASI AŞ	15.01.2021	3AyaKadarVD-THL-TRY	16,75	14	221.884,99	-	11.12.2020	18,08	-	16,75	-	224.014,54	14,78	2,00
ARA GRUP TOPLAMI						654.960,85							661.245,41	43,62	5,91
Katılma Payı	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ	-	ZGOLD.F	-	-	2.794,00	39,78	-	-	-	45,15	-	126.149,10	8,32	1,13
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ	-	ZPLIB.F	-	-	4.140,00	14,29	-	-	-	15,29	-	63.300,60	4,18	0,57
ARA GRUP TOPLAMI						6.934,00							189.449,70	12,50	1,69
GRUP TOPLAMI						1.328.188,41							1.516.018,50	100,00	13,56
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ													11.180.836,43		100,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

(eski adıyla "Halk Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2020			31 Aralık 2019		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A) FON PORTFÖY DEĞERİ	11.180.836	-	100,62	4.294.989	-	100,68
B) HAZIR DEĞERLER	4.986	-	0,04	901	-	0,02
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	4.986	100,00	0,04	901	100,00	0,02
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C) ALACAKLAR	9.322	-	0,08	4.546	-	0,11
a) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	9.322	100,00	0,08	4.546	100,00	0,11
D) DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E) BORÇLAR	83.124	-	0,75	34.255	-	0,80
a) Takasa Borçlar	-	-	-	9.315	27,19	0,22
b) Yönetim Ücreti	7.462	8,98	0,07	2.797	8,17	0,07
c) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
e) Krediler	-	-	-	-	-	-
f) Diğer Borçlar	57.729	69,45	0,52	22.015	64,27	0,52
g) Kayda Alma Ücreti	333	0,40	-	128	0,37	-
h) Pay geri alışından borçlar	17.600	21,17	0,16	-	-	-
Fon Toplam Değeri	11.112.021			4.266.181		