

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 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

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF 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 Agresif 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 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif 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 2020

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
--------------------	--------------

I- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER.....	1
II- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	2

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

47 - NHG 31/12/2019 Tarihli Gölük Raporudur

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Mevkul Kısmet	İhracat Kurum	İhtis Tarihi	Mevkul Tanımı	Nominal Fata Oranı	Faiz Ödeme Sırası	Nominal Değer/Kontrat Sayısı	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Şirketi No	Repo Teminat Tutarı	Gölük Birim Değer	Gölük Kur	Toplam Değer	Gölük (%)	Toplam (%)
LİSİSE SENEDE																
	T.C.		AEFES			715	22,8	24.12.2019				23,08	1	16.502,20	3,94%	2,39%
	T.C.		AKBNK			4.975,50	6,947803	24.12.2019				8,11	1	40.351,31	9,63%	5,85%
	T.C.		ARCLK			315	18,253065	24.12.2019				20,84	1	6.564,60	1,57%	0,92%
	T.C.		ASELS			950	18,853302	24.12.2019				20,94	1	19.893,08	4,73%	2,85%
	T.C.		BIMAS			400	43,401847	24.12.2019				46,66	1	18.664,00	4,49%	2,71%
	T.C.		ENISA			1.830,00	6,692548	24.12.2019				7,38	1	13.574,70	3,23%	1,96%
	T.C.		ERFEL			2.130,00	8,038672	24.12.2019				9,04	1	19.275,28	4,66%	2,75%
	T.C.		GABAN			3.575,00	8,577961	24.12.2019				11,14	1	39.875,50	9,51%	5,78%
	T.C.		ISCTR			2.080,00	5,828941	24.12.2019				6,41	1	13.101,80	3,26%	1,72%
	T.C.		ISCTR			510	19,88	24.12.2019				20,32	1	10.362,28	2,47%	1,59%
	T.C.		MAVI			190	52,85	24.12.2019				57,0	1	11.001,00	2,63%	1,69%
	T.C.		MEROS			505	18,592416	24.12.2019				24,22	1	12.231,10	2,92%	1,77%
	T.C.		OTLAR			65	133,286813	24.12.2019				159	1	10.375,00	2,47%	1,59%
	T.C.		PGSUS			195	81,874199	24.12.2019				86,4	1	16.848,00	4,02%	2,44%
	T.C.		SAHOL			460	8,844615	24.12.2019				9,54	1	6.201,00	1,48%	0,90%
	T.C.		SCDA			2.090,00	4,08	24.12.2019				6,48	1	13.360,00	3,25%	1,79%
	T.C.		TELL			1.260,00	12,801957	24.12.2019				14,8	1	24.288,00	5,89%	3,52%
	T.C.		THYAO			2.060,00	13,483448	24.12.2019				14,46	1	28.787,60	7,11%	4,32%
	T.C.		TKEN			555	21,472415	24.12.2019				19,33	1	18.722,60	4,58%	2,82%
	T.C.		TRCOY			3.960,00	5,311448	24.12.2019				5,75	1	10.899,00	2,60%	1,59%
	T.C.		TTKOM			2.450,00	5,447051	16.12.2019				7,37	1	16.585,50	3,90%	2,41%
	T.C.		TUPRS			250	122,786799	24.12.2019				126,0	1	31.700,00	7,75%	4,60%
	T.C.		YATAS			1.840,00	5,441098	24.12.2019				7,43	1	13.505,60	3,22%	1,85%
	T.C.		YKBNK			3.475,94	2,340852	24.12.2019				2,40	1	8.372,28	2,00%	1,21%
GRUP TOPLAMI																
BORÇLANMA SEVETLERİ																
BANKA BONDUSU																
	ALTERNATİF BANK	01.01.2020	TRFALNF20025	0,00%	0	20.000,00	97,454	25.11.2019	12,18%			98,99932	1	19.799,86	11,04%	2,87%
	Fimebank	06.03.2020	TRFTNBK32024	0,00%	0	20.000,00	97,531	31.12.2019	11,48%			98,1132	1	19.622,64	10,94%	2,85%
ARA GRUP TOPLAMI																
TINANSMAN BONDUSU																
	OSR Finans Yatırım Menkul Değerler	14.01.2020	TRFFNSY12024	0,00%	0	20.000,00	96,418	15.10.2019	15,76%			99,52014	1	19.904,03	11,10%	2,87%
	ISCOY	29.05.2020	TRFISGY52017	0,00%	0	30.000,00	94,761	04.12.2019	11,74%			99,60017	1	28.680,02	16,00%	4,10%
	İ. Yatırım A.Ş.	10.01.2020	TRFISMD12047	0,00%	0	20.000,00	96,52	08.10.2019	13,81%			99,71660	1	19.914,17	11,12%	2,89%
	Yeni Kredi Yatırım	29.01.2020	TRFYKYM12021	0,00%	0	30.000,00	98,054	27.11.2019	12,06%			99,16129	1	29.746,38	16,36%	4,31%
ARA GRUP TOPLAMI																
DEVLET TAHVİLİ																
	T.C.	08.07.2020	TH7080720T19	4,70%	0	40.000,00	101,8522	11.11.2019	1,31%			104,001467	1	41.600,59	23,20%	6,02%
ARA GRUP TOPLAMI																
GRUP TOPLAMI																
Ç.K.İTİMA BİLGESİ																
			GLATR			700	0	01.11.2019				26,455		18.738,50	100,00%	2,60%
GRUP TOPLAMI																
DOĞRUDAN İŞLEMLER																
E.YARANCI HİSSE																
E.YERS BEPO																
	T.C.	02.01.2020	TRT100620T16	9,80%		35.017,26	0,777778	31.12.2019			45.000,00	77,816134	1	35.017,26	100,00%	5,08%
GRUP TOPLAMI																
G.KATILIM HESABI																
İLLAVARLI MENKUL																
İLLAVARLI MENKUL																
E.YARANCI TAHVİL																
E.BORSA PARA PİYASASI																
		02.01.2020		10,85%		38.022,59	100	31.12.2019	0,00%			100,039452	1	38.022,59	100,00%	5,51%
GRUP TOPLAMI																
ELAVARLI İŞLEMLERİ																
İLLAVARLI İŞLEMLERİ																
NSWAP																
DELİBOBNO BEPO																
E.YARANCI İŞLEMLER																
FON PORTFÖY DEĞERİ																
DOVİZ BAKİTİLERİ																
			TRY			1.973,75	1	31.12.2019				1	1	1.973,75	100,00%	0,25%
GRUP TOPLAMI																

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2019			31 Aralık 2018		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	689.446		99,74%	209.089	-	98,61%
B.HAZIR DEĞERLER	1.974		0,29%	411	-	0,19%
b) Bankalar	1.974	100,00%	0,29%	411	100,00%	0,19%
i) TL Hesaplar	1.974	100,00%	0,29%	411	100,00%	0,19%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	8.689		1,26%	4.975	-	2,07%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	4.975	100,00%	2,07%
d) Diğer Alacaklar	8.689	1,00	0,01	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00%	0	-	0,00%
E.BORÇLAR	7.307		-1,29%	1.850	-	-0,87%
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0	0	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	478	5,38%	-0,07%	149	8,04%	-0,07%
d) Ödenecek Vergi	0	0	0	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0	0	-	-	-
f) Krediler	0	0	0	-	-	-
g) Diğer Borçlar	6.829	94,62%	-1,22%	1.701	91,96%	-0,80%
i) Denetim Ücreti	596	6,71%	-0,09%	800	43,21%	-0,38%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	200	2,25%	-0,03%	69	3,75%	-0,03%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	26	0,29%	0,00%	9	0,46%	0,00%
iv) Noter masrafı	0	0	0	-	-	-
v) İlan giderleri	0	0	0	-	-	-
vi) Karşılıklar	3.344	1	0	-	-	-
vii) Diğer	2.664	29,98%	-0,39%	824	44,53%	-0,39%
M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00%	0	-	0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	692.802		100,00%	212.625		100,00%
Fon toplam değeri (TL)	692.802			212.625		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	59.077.017			23.322.208		
Birim pay değeri (TL)	0,011727			0,009117		