

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DİNAMİK KATILIM 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 DİNAMİK KATILIM 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 Dinamik Katılım 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 Dinamik Katılım 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 DİNAMİK KATILIM DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU	SAYFA
I- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER.....	1
II- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	2

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DİNAMİK KATILIM DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU
(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL.") olarak ifade edilmiştir.)

51 - NHH 31/12/2019 Tarihli Günlük Raporudur

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU																		
Menkul Kıymet	İhracı Kurum	İfa Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/Kontrat Sayısı	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)		
A.HİSSE SENEDİ																		
	T.C.		AŞEL S			100	21.44	19.04.2019				20.84	1	2.094.00	3.82%	0.48%		
	T.C.		EREGL			2.000.00	6.73	17.10.2019				9.04	1	18.080.00	32.95%	4.18%		
	T.C.		KRONT			1.000.00	9.04	02.08.2019				12.72	1	12.720.00	23.18%	2.94%		
	T.C.		MAVI			150	40.44	10.12.2019				57.0	1	8.685.00	15.83%	2.01%		
	T.C.		ULUSE			500	24	17.10.2019				26.6	1	13.300.00	24.24%	3.08%		
GRUP TOPLAMI														54.879.00		12.69%		
B.BORÇLANMA SENETLERİ																		
KİRA SERTİFİKALARI																		
	T.C.	10.02.2021	TRD100221T17	8.80%	6	40.000.00	107.007772	07.11.2019	0.00%			113.885948	1	45.554.38	12.07%	10.54%		
	T.C.	12.02.2020	TRD120220T16	6.36%	6	160.000.00	102.865219	25.12.2019	9.45%			105.286107	1	168.457.72	44.63%	38.97%		
	T.C.	14.07.2021	TRD140721T18	4.70%	6	20.000.00	88.6651	16.08.2019	0.41%			104.050698	1	20.810.14	5.51%	4.81%		
	T.C.	18.11.2020	TRD181120T19	8.95%	6	80.000.00	104.5031	20.11.2019	0.60%			108.375483	1	86.700.39	22.97%	20.05%		
	T.C. MERKEZ BANKASI	23.09.2020	TRD230920T24	12.20%	6	47.992.00	109.649952	19.08.2019	0.00%			116.510854	1	55.915.80	14.81%	12.93%		
ARA GRUP TOPLAMI														347.992.00		87.31%		
GRUP TOPLAMI														347.992.00		87.31%		
C.KATILMA BELGESİ																		
D.OPSİYON İŞLEMLER																		
E.YABANCI HİSSE																		
E.TERS REPO																		
G.KATILIM HESABI																		
H.VADELİ MEVDUAT																		
L.KİYMETLİ MADEN																		
LYABANCI TAHVİL																		
K.BORSA PARA PİYASASI																		
L.VARANT İŞLEMLERİ																		
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																		
N.SWAP																		
O.EUROBOND REPO																		
P.TÜREV İŞLEMLER																		
FON PORTFÖY DEĞERİ														0		432.317.57		
DÖVİZ BAKİYESLERİ																		
			TRY			6.761.03	1	31.12.2019				1	1	6.761.03	100.00%	1.56%		
GRUP TOPLAMI																6.761.03		1.56%

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**OKS DİNAMİK KATILIM 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	432.318		99,22%	100.679	-	91,59%
B.HAZIR DEĞERLER	6.761		1,55%	6.765	-	6,15%
b) Bankalar	6.761	100,00%	1,55%	6.765	100,00%	6,15%
i) TL Hesaplar	6.761	100,00%	1,55%	6.765	100,00%	6,15%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	7.894		1,82%	5.079	-	4,19%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	5.079	100,00%	4,19%
d) Diğer Alacaklar	7.894	1	0	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00%	0	-	0,00%
E.BORÇLAR	9.179		-2,59%	2.120	-	-1,93%
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0	0	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	297	2,64%	-0,07%	76	3,58%	-0,07%
d) Ödenecek Vergi	0	0	0	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0	0	-	-	-
f) Krediler	0	0	0	-	-	-
g) Diğer Borçlar	8.881	97,36%	-2,52%	2.044	96,42%	-1,86%
i) Denetim Ücreti	596	5,29%	-0,14%	800	37,72%	-0,73%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	191	1,69%	-0,04%	132	6,23%	-0,12%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	18	0,16%	0,00%	6	0,30%	-0,01%
iv) Noter masrafı	0	0	0	-	-	-
v) İlan gideleri	0	0	0	-	-	-
vi) Karşılıklar	1.925	0	0	-	-	-
vii) Diğer	6.151	54,56%	-1,41%	1.106	52,17%	-1,01%
M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00%	0	-	0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	437.794		100,00%	110.403		100,00%
Fon toplam değeri (TL)	437.794			110.403		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	32.377.001			10.413.355		
Birim pay değeri (TL)	0,013522			0,010602		