

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ 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 DENGELİ 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 Dengeli 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 Dengeli 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 DENGELİ 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 DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

49 - NHI 31/12/2019 Tarihli Günlük Raporudur

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Mevkul Kıymet	Biracısı Kurum	Alın Tarihi	Mevkul Tanımı	Nominal Fahi Oranı	Fahi Ödeme Sayısı	Nominal Değer/Kontrol Sayısı	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İskontu Oranı	Borsa Sözleşme No	Repa Teslimat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Totlam Değer	Gross (%)	Totlam (%)
A HİSSE SENEDİ																
	T.C.		AFFES			433	22.58	24.12.2019				23.08	1	10.039.80	10.11%	1.58%
	T.C.		AKBNK			1.175.00	5.8996	24.12.2019				8.11	1	9.529.25	9.69%	1.50%
	T.C.		BREGL			1.105.00	9.317726	24.12.2019				9.04	1	9.989.20	10.06%	1.57%
	T.C.		GARAN			876	7.58014	24.12.2019				11.14	1	9.747.50	9.82%	1.54%
	T.C.		GZNGV			3.975.00	2.41	24.12.2019				2.57	1	10.215.75	10.29%	1.61%
	T.C.		SAHOL			1.545.00	6.918576	24.12.2019				9.54	1	14.739.30	14.84%	2.32%
	T.C.		TAVHİ			335	28.84	24.12.2019				23.18	1	9.775.40	9.85%	1.54%
	T.C.		TOTO			1.045.00	14.892416	24.12.2019				14.46	1	15.110.70	15.22%	2.38%
	T.C.		TKFEN			525	18.26	24.12.2019				19.32	1	10.143.00	10.22%	1.60%
GRUP TOPLAMI						11.015.00								99.289.80		15.64%
B BORÇLANMA SENETLERİ																
BANKA BONSU																
	ALTERNATİF BANK	04.02.2020	TREAFNF2017	0.00%	0	20.000.00	97.61	06.11.2019	13.10%			98.8931	1	19.778.64	4.16%	3.12%
	Faahbank	06.03.2020	TREFFNBK3024	0.00%	0	25.000.00	97.531	13.12.2019	11.48%			98.1132	1	24.528.30	5.16%	8.09%
ARA GRUP TOPLAMI						45.000.00								44.306.95		6.98%
FINANSMAN BONSU																
	RGYO	29.05.2020	TRESCV52017	0.00%	0	20.000.00	94.761	04.12.2019	11.74%			95.60012	1	19.120.00	4.02%	3.01%
	Yeni Kredi Yatırım	29.01.2020	TREYKCYM1201	0.00%	0	20.000.00	98.054	27.11.2019	12.06%			99.161529	1	19.872.28	4.17%	3.12%
ARA GRUP TOPLAMI						40.000.00								38.992.28		6.14%
DEVLET TAHVİLİ																
	T.C.	05.02.2020	TRT05022017	3.70%	6	200.000.00	96.2818	13.11.2019	10.54%			102.786403	1	206.472.81	43.21%	32.37%
	T.C.	09.07.2020	TRT09072019	4.70%	0	80.000.00	109.363465	13.11.2019	13.11%			104.001462	1	83.201.17	17.50%	13.11%
	T.C.	10.06.2020	TRT10062016	0.00%	0	60.000.00	84.683533	31.10.2019	11.00%			95.5296	1	57.317.58	12.05%	9.03%
ARA GRUP TOPLAMI						40.000.00	114.473075	18.12.2019	0.00%			115.57772	1	46.431.11	9.72%	7.28%
GRUP TOPLAMI						465.000.00								392.222.85		61.78%
L KATILMA BELGESİ														475.482.06		74.90%
			GLDTR			600	0	11.07.2019				26.055	1	15.763.30	62.93%	2.40%
			GMSTR			410	0	11.07.2019				22.651	1	9.286.91	37.07%	1.46%
GRUP TOPLAMI						1.015.00								25.050.10		3.95%
DOPUNU İSLEMLER																
E YARANCI HİSSE																
E TERS REPO																
G KATILIM HESABI																
H YADELİ MEYDAT																
L KİT METLİ MADEN																
L YARANCI TAHVİL																
R BORSİ PARA PİYASASI		02.01.2020		10.85%		35.020.81	100	31.12.2019	0.00%			100.059452	1	35.020.81	100.00%	5.52%
GRUP TOPLAMI						35.020.81								35.020.81		5.52%
L YARANCI İSLEMLERİ																
M TEMİNAT İSLEMLERİ																
NSWAP																
OLUŞURDUN REPO																
P TİREBİ İSLEMLER																
FON PORTFÖY DEĞERİ						512.050.81						0		634.842.85		
BÖLÜŞ BAKİTİLERİ																
			TRY			3.093.27	1	31.12.2019				1	1	3.093.27	100.00%	0.49%
GRUP TOPLAMI						3.093.27								3.093.27		0.49%

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ 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 2018			31 Aralık 2018		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	634.843		99,15%	248.442	-	98,64%
B.HAZIR DEĞERLER	3.093		0,48%	441	-	0,18%
b) Bankalar	3.093	100,00%	0,48%	441	100,00%	0,18%
i) TL Hesaplar	3.093	100,00%	0,48%	441	100,00%	0,18%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	8.205		1,28%	4.905	-	1,94%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	4.905	100,00%	1,94%
d) Diğer Alacaklar	8.205	1	0,0128	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00%	0	-	0,00%
E.BORÇLAR	5.632		-0,91%	1.917	-	-0,76%
a) Takasa Borçlar T1	0	0,00%	0,00%	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00%	0,00%	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	455	7,78%	-0,07%	172	8,99%	-0,07%
d) Ödenecek Vergi	0	0,00%	0,00%	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0,00%	0,00%	-	-	-
f) Krediler	0	0,00%	0,00%	-	-	-
g) Diğer Borçlar	5.177	92,22%	-0,84%	1.745	91,01%	-0,69%
i) Denetim Ücreti	596	10,19%	-0,09%	800	41,70%	-0,32%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	157	2,69%	-0,02%	113	5,89%	-0,04%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	27	0,46%	0,00%	9	0,45%	0,00%
iv) Noter masrafı	0	0,00%	0,00%	-	-	-
v) İlan gideleri	0	0,00%	0,00%	-	-	-
vi) Karşılıklar	1.605	31,15%	-0,28%	-	-	-
vii) Diğer	2.792	47,73%	-0,44%	824	42,97%	-0,33%
M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00%	0	-	0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	640.509		100,00%	251.870		100,00%
Fon toplam değeri (TL)	640.509			251.870		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	48.670.978			23.499.011		
Birim pay değeri (TL)	0,01316			0,010718		