

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

48 - NHL 31/12/2019 Tarihli Günlük Raporudur

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Mevküt Kıymet	Birimi/Kurum	Alın Tarihi	Mevküt Tanımı	Nominal Fiyat Dramı	Faiz Ödeme Sırası	Nominal Değer/Kontrol Sırası	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İskonto Dramı	Borçlu Sözleşme No	Repo Teminatı Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Tonlam Değer	Gross (%)	Tonlam (%)
A HİSSE SENEDİ																
T.C.	AKFES			745		22.54	24.12.2020					23.08	1	17.184.60	9.88%	2.12%
T.C.	AKBNK			2.075.60		5.89100	24.12.2020					8.11	1	16.833.12	9.65%	2.08%
T.C.	EREG			1.945.00		9.18152	24.12.2020					9.84	1	17.582.80	10.08%	2.17%
T.C.	GARAN			1.545.00		7.743201	24.12.2020					11.14	1	17.211.40	9.87%	2.12%
T.C.	GRNGY			7.890.00		2.41	24.12.2020					2.57	1	17.990.08	10.35%	2.22%
T.C.	SAHIL			2.725.00		8.801497	24.12.2020					9.54	1	25.986.50	14.91%	3.21%
T.C.	TAVH			590		28.76	24.12.2020					28.18	1	17.616.20	9.82%	2.12%
T.C.	TIPAC			1.820.00		14.081658	24.12.2020					14.46	1	26.606.40	15.78%	3.38%
T.C.	TIPFN			920		18.23	24.12.2020					19.32	1	17.774.48	10.19%	2.19%
GRUP TOPLAMI				19.385.60										174.405.32		21.51%
B BORÇLANMA SENETLERİ																
BANKA BONSU																
	ALTERNATİF BANK	04.02.2020	TREALNF22017	0.00%	0	20.000.00	07.01	06.11.2020	13.10%			38.88111	1	19.778.62	3.75%	2.44%
	Embank	06.03.2020	TRETNBKS2024	0.00%	0	25.000.00	97.531	13.12.2020	11.48%			98.1132	1	24.578.34	4.65%	3.02%
ARA GRUP TOPLAMI						45.000.00								44.306.96		5.46%
FINANSMAN BONSU																
	İS GYO	29.05.2020	TREISGY2017	0.00%	0	20.000.00	94.761	04.12.2020	11.74%			95.68012	1	19.130.02	3.62%	2.36%
	Yeni Kredi Yatırım	29.01.2020	TREYKYM12021	0.00%	0	20.000.00	98.054	27.11.2020	12.06%			99.16120	1	19.832.28	3.76%	2.45%
ARA GRUP TOPLAMI						40.000.00								38.962.30		4.00%
DEVLET TAHHÜTİ																
T.C.	05.02.2020	TREDSO220T17	3.70%	5	70.000.00	101.192314	13.11.2020	10.54%				102.736403	1	71.915.48	13.62%	8.87%
T.C.	08.07.2020	TREDSO720T19	4.70%	5	70.000.00	99.8	09.10.2020	1.31%				104.001462	1	72.801.03	13.79%	8.98%
T.C.	10.06.2020	TRETD0620T16	0.00%	0	80.000.00	83.639863	20.10.2020	11.00%				85.5296	1	76.421.68	14.47%	9.42%
T.C.	12.08.2020	TRETD0820T12	11.20%	4	10.000.00	104.9288	02.05.2020	0.09%				116.14775	1	11.614.78	2.28%	1.43%
T.C.	13.05.2020	TRETD0520T14	0.00%	0	100.000.00	80.74126	21.06.2020	10.67%				86.40151	1	96.491.51	18.20%	11.89%
ARA GRUP TOPLAMI						100.000.00	114.40433	27.12.2020	0.00%			115.577772	1	115.577.77	21.89%	14.25%
GRUP TOPLAMI						430.000.00								444.754.77		54.84%
G KATILIM BELGESİ						515.000.00								527.993.48		65.11%
	GLDTR			450		0	11.07.2020					26.052	1	16.935.74	38.91%	2.80%
	GMSYR			820		0	11.07.2020					22.051	1	18.573.82	42.67%	2.29%
	USDTR			14		0	11.07.2020					572.592	1	8.016.20	18.43%	0.99%
GRUP TOPLAMI						1.484.00								43.525.88		5.37%
ROPORTYON İŞLEMLER																
E-YARANCI HİSSE																
E-TİRS REPO																
G KATILIM HESABI																
H VADELİ MEVDUAT																
H KİTİ METLİ MADEN																
E-YARANCI LARH																
E-BORSA PARA PİYASASI																
GRUP TOPLAMI		02.01.2020		10.85%		65.038.64	100	31.12.2020	0.00%			100.059452	1	65.038.64	100.00%	8.02%
E-YARANCI İŞLEMLERİ						65.038.64								65.038.64		8.02%
ALTERNATİF İŞLEMLERİ																
NSWAP																
OUTERBOND REPO																
E-TİRS İŞLEMLER																
FON PORTFÖY DEĞERİ						600.508.24					0			810.963.48		
ROPORTYON DEĞERİ																
GRUP TOPLAMI			TRY			2.971.77	1	31.12.2020				1	1	2.971.77	100.00%	0.37%
GRUP TOPLAMI						2.971.77								2.971.77		0.37%

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DİNAMİK 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	810.963		99,60%	262.800	-	98,47%
B.HAZIR DEĞERLER	2.972		0,37%	1.058	-	0,40%
b) Bankalar	2.972	100,00%	0,37%	1.058	100,00%	0,40%
i) TL Hesaplar	2.972	100,00%	0,37%	1.058	100,00%	0,40%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	8.146		1,00%	4.964	-	1,85%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	4.964	100,00%	1,85%
d) Diğer Alacaklar	8146,25	1	0,01	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00%	0	-	0,00%
E.BORÇLAR	7.586		-0,97%	1.933	-	-0,72%
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0	0	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	550	6,95%	-0,07%	182	9,39%	-0,07%
d) Ödenecek Vergi	0	0	0	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0	0	-	-	-
f) Krediler	0	0	0	-	-	-
g) Diğer Borçlar	7.036	93,05%	-0,90%	1.752	90,61%	-0,66%
i) Denetim Ücreti	596	7,53%	-0,07%	800	41,35%	-0,30%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	169	2,14%	-0,02%	120	6,19%	-0,04%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	30	0,38%	0,00%	9	0,46%	0,00%
iv) Noter masrafı	0	0	0	-	-	-
v) İlan gideleri	0	0	0	-	-	-
vi) Karşılıklar	3579,12	0,4935	-0,0048	-	-	-
vii) Diğer	2.662	33,65%	-0,33%	824	42,61%	-0,31%
M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00%	0	-	0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	814.495		100,00%	266.889		100,00%
Fon toplam değeri (TL)	814.495			266.889		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	63.332.374			25.964.956		
Birim pay değeri (TL)	0,012861			0,010279		