

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS KATILIM STANDART 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 KATILIM STANDART 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 Katılım Standart 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 Katılım Standart 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 KATILIM STANDART 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 KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Futurist aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmektedir.)

45 - NHR 31/12/2019 Tarihli Günlük Raporudur

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU													
Meskal Kıymet	Biracık Kararım	Hfca Tarihi	Meskal Tanım	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/Kontrat Sayısı	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İskonto Oran	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur
AHİSSE SENEĐİ													
T.C.			ALKİM			10.000,00	22.6615	17.09.2019				38,32	1
T.C.			BİMAS			5.000,00	48,54	26.09.2019				46,66	1
T.C.			EGOB			110.000,00	3.140999	17.06.2019				3,71	1
T.C.			EREGL			75.000,00	6,21	26.08.2019				9,94	1
T.C.			KRONT			25.000,00	8,711003	16.05.2019				12,72	1
GRUP TOPLAMI						225.000,00							
B.BORÇLANMA SENETLERİ													
KİRA SERTİFİKALARI													
T.C.		10.02.2021	TRD100221T17	8,80%	6	3.180.000,00	101,613432	11.12.2019	0,00%			113,885948	1
T.C.		10.08.2022	TRD100822T10	5,38%	6	1.010.000,00	95,99608	25.11.2019	0,00%			106,414676	1
T.C.		12.02.2020	TRD120220T16	6,30%	6	8.860.000,00	101,226633	19.12.2019	9,45%			105,286107	1
T.C.		14.07.2021	TRD140721T18	4,70%	6	1.200.000,00	92,411173	19.08.2019	0,41%			104,059689	1
T.C.MERKEZ BANKASI		23.09.2020	TRD230920T24	12,20%	6	4.829.497,00	109,114113	09.09.2019	0,00%			116,510854	1
T.C.MERKEZ BANKASI		30.10.2024	TRD301024T10	1,65%	6	690.000,00	100	06.11.2019	0,00%			107,740149	1
T.C.		12.02.2020	TRD120220T14	3,65%	3	1.210.000,00	102,260354	01.01.2019	16,79%			101,659451	1
T.C.		17.04.2020	TRD170420T12	4,69%	3	1.100.000,00	100,945717	22.04.2019	0,00%			106,044483	1
T.C.		17.06.2020	TRD170620T10	4,99%	3	250.000,00	101,073316	01.01.2019	10,95%			106,111172	1
YATIRIM VARLIK KİRALAMA A.Ş.		24.12.2001	TRDYKSA1119	4,14%	3	1.500.000,00	100	27.12.2019	1,83%			1.584.018,53	1
Ziraat Katılım Varlık Yatırım A.Ş.		14.01.2020	TRDZKVK12023	3,45%	12	680.000,00	100	11.10.2019	10,45%			103,111252	1
ARA GRUP TOPLAMI						24.419.497,00						26.401.136,22	
GRUP TOPLAMI						24.419.497,00						26.401.136,22	
Ç.KATILMA BELGESİ													
			ALBTS.F1			150	1.189,13	20.08.2019				1.220,90	1
			ALDJK.F1			150	1.104,27	21.08.2019				1.155,40	1
			ICI			299.257,00	1.047375	07.08.2019				1.17254	1
			GPFR.F1			1.500,00	0	29.11.2019				1.107,80	1
			RPI			300.000,00	1.23482	01.01.2019				1.481,97	1
			RPI			200.000,00	1	01.01.2019				1.64933	1
			RPVS			1.092,38	01,01	01.01.2019				1.385,80	1
			YD3			700.000,00	1,072689	16.09.2019				1.251,387	1
GRUP TOPLAMI						1.501.732,00						4.886.311,90	
D.OPİYON İŞLEMLERİ													
L.VARANT İŞLEMLERİ													
F.FERS REPO													
G.KATILIM HESABI													
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		06.01.2020	KH08/07/2019.EKT18 ZG	22,50%		10.000,00	100	08.07.2019	0,00%			110,972603	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		06.01.2020	KH10/07/2019.EKT18 ZG	20,00%		10.000,00	100	10.07.2019	0,00%			109,643836	1
Ziraat Katılım Bankası		21.01.2020	KH12/07/2019.ZKB18 ZG	19,10%		10.000,00	100	25.07.2019	0,00%			108,424932	1
Ziraat Katılım Bankası		10.06.2020	KH09/12/2019.184G.Z KB	10,80%		100.000,00	100	09.12.2019	0,00%			100,710137	1
Ziraat Katılım Bankası		11.05.2020	KH11/11/2019.ZKB18 ZG	12,30%		100.000,00	100	11.11.2019	0,00%			101,752329	1
Ziraat Katılım Bankası		10.06.2020	KH13/12/2019.ZKB18 ZG	10,80%		100.000,00	100	13.12.2019	0,00%			100,591781	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		11.02.2020	KH15/08/2019.EKT18 ZG	16,25%		100.000,00	100	15.08.2019	0,00%			106,232877	1
Ziraat Katılım Bankası		21.01.2020	KH23/07/2019.ZKB18 ZG	19,00%		100.000,00	100	23.07.2019	0,00%			108,484932	1
Ziraat Katılım Bankası		07.04.2020	KH09/10/2019.ZKB18 ZG	12,50%		130.000,00	100	09.10.2019	0,00%			102,910959	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		02.01.2020	KH29/11/2019.EKT34 ZG	11,50%		1.500.000,00	100	29.11.2019	0,00%			101,071233	1
Ziraat Katılım Bankası		02.01.2020	KH29/11/2019.ZKB34 ZG	11,60%		1.600.000,00	100	29.11.2019	0,00%			101,080548	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		06.01.2020	KH09/07/2019.EKT18 ZG	22,50%		20.000,00	100	09.07.2019	0,00%			110,910959	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		10.03.2020	KH10/09/2019.EKT18 ZG	16,50%		20.000,00	100	10.09.2019	0,00%			105,153425	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		16.01.2020	KH17/07/2019.EMK.1 ZG	18,00%		20.000,00	100	17.07.2019	0,00%			108,334247	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		23.03.2020	KH24/09/2019.EKT.18 ZG	13,75%		200.000,00	100	24.09.2019	0,00%			103,767123	1
Ziraat Katılım Bankası		23.03.2020	KH12/09/2019.ZKB18 ZG	14,05%		200.000,00	100	24.09.2019	0,00%			103,849315	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		27.04.2020	KH28/10/2019.EKT18 ZG	12,35%		200.000,00	100	28.10.2019	0,00%			102,233151	1
Ziraat Katılım Bankası		27.04.2020	KH28/10/2019.ZKB18 ZG	12,55%		200.000,00	100	28.10.2019	0,00%			102,269315	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		28.05.2020	KH29/11/2019.EKT18 ZG	15,67%		200.000,00	100	29.11.2019	0,00%			101,459615	1
Ziraat Katılım Bankası		28.05.2020	KH29/11/2019.ZKB18 ZG	11,60%		200.000,00	100	29.11.2019	0,00%			101,080548	1
Ziraat Katılım Bankası		20.02.2020	KH20/08/2019.ZKB.18 ZG	15,80%		220.000,00	100	20.08.2019	0,00%			105,843836	1
Ziraat Katılım Bankası		16.01.2020	KH16/07/2019.ZKT.18 ZG	18,50%		222.726,00	100	16.07.2019	0,00%			108,616438	1
Ziraat Katılım Bankası		20.01.2020	KH18/12/2019.ZKB33 ZG	10,20%		260.000,00	100	18.12.2019	0,00%			100,419178	1
Ziraat Katılım Bankası		29.01.2020	KH01/08/2019.ZKB.18 ZG	17,30%		30.000,00	100	01.08.2019	0,00%			107,298178	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		03.03.2020	KH03/09/2019.EKT.18 ZG	15,00%		30.000,00	100	03.09.2019	0,00%			104,972603	1
Ziraat Katılım Bankası		15.06.2020	KH18/12/2019.ZKB18 ZG	10,10%		30.000,00	100	18.12.2019	0,00%			100,415068	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		16.01.2020	KH16/07/2019.EKT.18 ZG	19,80%		367.274,00	100	16.07.2019	0,00%			108,849315	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		29.01.2020	KH02/08/2019.EKT.18 ZG	17,50%		40.000,00	100	02.08.2019	0,00%			107,335616	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		05.02.2020	KH05/08/2019.EKT.18 ZG	15,80%		40.000,00	100	05.08.2019	0,00%			106,493151	1
Ziraat Katılım Bankası		07.05.2020	KH07/11/2019.ZKB.18 ZG	12,30%		40.000,00	100	07.11.2019	0,00%			101,887123	1
Ziraat Katılım Bankası		16.01.2020	KH18/07/2019.ZKB.18 ZG	18,50%		40.000,00	100	18.07.2019	0,00%			106,515068	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		14.04.2020	KH16/10/2019.EKT18 ZG	13,30%		50.000,00	100	16.10.2019	0,00%			102,842192	1
Ziraat Katılım Bankası		20.05.2020	KH21/11/2019.ZKT.18 ZG	12,05%		50.000,00	100	21.11.2019	0,00%			101,386575	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		20.02.2020	KH20/08/2019.EKT.18 ZG	15,25%		536.268,76	100	20.08.2019	0,00%			105,640411	1
Ziraat Katılım Bankası		03.03.2020	KH03/09/2019.ZKB.18 ZG	15,80%		60.000,00	100	03.09.2019	0,00%			105,237808	1
Ziraat Katılım Bankası		14.01.2020	KH09/12/2019.36G.ZK B	11,00%		670.000,00	100	09.12.2019	0,00%			100,723288	1
Ziraat Katılım Bankası		14.01.2020	KH13/12/2019.ZKB32 ZG	11,00%		720.000,00	100	13.12.2019	0,00%			100,60274	1
Ziraat Katılım Bankası		29.01.2020	KH29/07/2019.ZKB18 ZG	17,30%		80.000,00	100	29.07.2019	0,00%			107,44137	1
Türkiye Enaml Katılım Bankası A.Ş.		18.05.2020	KH19/11/2019.EKT.18 ZG	16,90%		90.000,00	100	19.11.2019	0,00%			102,037031	1
GRUP TOPLAMI						8.596.268,76						8.619.893,35	
L.V.ADELLİ MEVDUAT													
L.KİYMETLİ MADEN													
L.VARANT FAHRE													
K.BORSA PARA FİYASARI													
L.VARANT İŞLEMLERİ													
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ													
NSWAP													
ÖZELBORNO REPO													
P.FUTURİ İŞLEMLER													
FON PORTFÖY DEĞERİ						34.742.497,76					0		
BÜYÜK BAKİTELERİ													
			TRY			47.501,93	1	31.12.2019				1	1
GRUP TOPLAMI						47.501,93						47.501,93	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS KATILIM STANDART 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	42.127.941		101,05%	26.702.495	-	100,20%
B.HAZIR DEĞERLER	47.502		0,11%	6.976	-	0,03%
b) Bankalar	47.502	100,00%	0,11%	6.976	100,00%	0,03%
i) TL Hesaplar	47.502	100,00%	0,11%	6.976	100,00%	0,03%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	0	-	0,00%	0	-	0,00%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00%	0	-	0,00%
E.BORÇLAR	356.366		-1,16%	60.414	-	-0,23%
a) Takasa Borçlar T1	0	0,00%	0,00%	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00%	0,00%	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	30.366	6,28%	-0,07%	18.399	30,45%	-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	325.999	93,72%	-1,09%	42.015	69,55%	-0,16%
i) Denetim Ücreti	596	0,12%	0,00%	800	1,32%	0,00%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	1.001	0,21%	0,00%	625	1,03%	0,00%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	2.687	0,56%	-0,01%	1.452	2,40%	-0,01%
iv) Noter masrafı	0	0,00%	0,00%	-	-	-
v) İlan giderleri	0	0,00%	0,00%	-	-	-
vi) Karşılıklar	317.382	91,93%	-1,07%	35.461	58,69%	-0,13%
vii) Diğer	4.333	0,90%	-0,01%	3.678	6,09%	-0,01%
M.D.Düşüş Karşılığı	0		0,00%	0		0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	41.819.078	-	100,00%	26.649.057	-	100,00%
Fon toplam değeri (TL)	41.819.078			26.649.057		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	2.979.312.721			2.349.806.933		
Birim pay değeri (TL)	0,014036			0,011341		