

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

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FONU TANITICI BİLGİLER.....	1
II- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	2

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

50 - NHC 31/12/2019 Tarihli Günlük Raporudur

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Braççı Kurum	İfa Tarihi	Menkul Tammı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sıklığı	Nominal Değer/Kontrat Sayısı	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç Iskonto Oranı	Borsa Südesime No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A.HİSSE SENEDİ																
	T.C.		ELCET			3.472.000	4,00	31.12.2019				4,30		14.854,14	77,80%	70,11%
	T.C.		EREG			2.000.000	6,75	17.10.2019				9,04	1	18.080,00	26,69%	4,72%
	T.C.		KRON			1.000.000	9,0390	02.08.2019				12,72	1	12.720,00	18,78%	3,32%
	T.C.		MAVİ			150	40,44	10.12.2019				57,9	1	8.685,00	12,82%	2,27%
	T.C.		ULUSE			500	24	17.10.2019				26,6	1	13.300,00	19,63%	3,47%
GRUP TOPLAMI						7.072,00								67.739,14		17,69%
B.BORÇLANMA SENETLERİ																
KİRA SERTİFİKALARI																
	T.C.	10.02.2021	TRD100221T17	8,80%	6	40.000,00	107,445748	07.11.2019	0,00%			113,885948	1	45.554,38	14,45%	11,90%
	T.C.	10.08.2022	TRD100822T10	5,38%	6	20.000,00	96,18575	02.10.2019	0,00%			106,414670	1	21.282,84	6,75%	5,56%
	T.C.	12.02.2020	TRD120220T16	6,36%	6	110.000,00	101,728858	31.12.2019	9,45%			105,286107	1	115.814,72	36,75%	30,25%
	T.C.	14.07.2021	TRD140721T18	4,70%	6	10.000,00	92,2747	16.08.2019	0,41%			104,050698	1	10.405,07	3,30%	2,72%
	T.C.	18.11.2020	TRD181120T19	8,95%	6	60.000,00	102,842133	20.11.2019	0,60%			108,375483	1	65.025,20	20,63%	16,98%
	T.C.MERKEZ BANKASI	23.09.2020	TRD230920T24	12,20%	6	40.996,00	111,296547	09.08.2019	0,00%			116,510854	1	57.085,66	18,11%	14,91%
ARA GRUP TOPLAMI						288.996,00								315.168,05		82,31%
GRUP TOPLAMI						288.996,00								315.168,05		82,31%
C.KATILMA BELGESİ																
D.OPSİYON İŞLEMLERİ																
E.YABANCI HİSSE																
F.TERS REPO																
G.KATILIM HESABI																
H.YADELİ MEYDUT																
L.KİYMETLİ MADEN																
J.YABANCI TAHVİL																
K.BORSA PARA PİYASASI																
L.VARANT İŞLEMLERİ																
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																
N.SWAP																
O.EUROBOND REPO																
P.TÜREV İŞLEMLERİ																
FON PORTFÖY DEĞERİ						296.066,00					6			382.907,18		
DÖVİZ BAKİYELERİ																
			TRY			4.953,74	1	31.12.2019				1	1	4.953,74	100,00%	1,29%
GRUP TOPLAMI						4.953,74								4.953,74		1,29%

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**OKS AGRESİF 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	382.907		99,07%	89.890	-	92,45%
B.HAZIR DEĞERLER	4.954		1,29%	4.367	-	4,49%
b) Bankalar	4.954	100,00%	1,28%	4.367	100,00%	4,49%
i) TL Hesaplar	4.954	100,00%	1,28%	4.367	100,00%	4,49%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	8.158		2,11%	4.801		4,93%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	4.801	100,00%	4,93%
d) Diğer Alacaklar	8.158	1,00	0,02	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	-		-	-		-
E.BORÇLAR	7.447		-2,47%	1.821		-1,87%
a) Takasa Borçlar T1	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00	0,00	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	271	2,84%	-0,07%	67	3,69%	-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	7.175	97,16%	-2,40%	1.754	96,31%	-1,80%
i) Denetim Ücreti	596	6,25%	-0,15%	800	43,93%	-0,82%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	189	1,99%	-0,05%	124	6,80%	-0,13%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	16	0,17%	0,00%	6	0,32%	-0,01%
iv) Noter masrafı	0	0,00	0,00	-	-	-
v) İlan giderleri	0	0,00	0,00	-	-	-
vi) Karşılıklar	1.820	0,41	-0,01	-	-	-
vii) Diğer	4.553	47,74%	-1,18%	825	45,26%	-0,85%
M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00%	0	-	0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	388.573		100,00%	97.238		100,00%
Fon toplam değeri (TL)	388.573			97.238		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	28.594.005			9.237.780		
Birim pay değeri (TL)	0,013589			0,010526		