

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 HESAP DÖNEMİNE AİT
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



TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım 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**

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. ZEM OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun (eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu”) (“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 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Fon’un 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 Türkiye 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.

Talar Gül, SMMM
Sorumlu Denetçi



İstanbul, 29 Nisan 2021

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Değer/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutarı	Birim Değeri	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A. PAY															
	AKBANK TAS	-	AKBNK.E	-	-	147709	6,181	-	-	-	6,93	-	1023623,37	5,0217	3,6813
	AKSİGORTA	-	AKGRT.E	-	-	47656	7,149	-	-	-	9,3	-	443200,8	2,1742	1,5939
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	AKSEN.E	-	-	26570	7,02	-	-	-	7,44	-	197680,8	0,9698	0,7109
	ARÇELİK	-	ARCLK.E	-	-	15414	20,789	-	-	-	30,4	-	468585,6	2,2988	1,6852
	ASELSAN	-	ASELS.E	-	-	40514	13,451	-	-	-	18,25	-	739380,5	3,6272	2,6591
	AYGAZ	-	AYGAZE	-	-	13115	11,994	-	-	-	14,65	-	192134,75	0,9426	0,691
	BİM MAĞAZALAR	-	BIMAS.E	-	-	13.286,00	60,70	-	-	-	75,500	-	1.003.093,000	4,92	3,61
	DOĞAN HOLDİNG	-	DOHOLE	-	-	107.281,00	2,08	-	-	-	3,070	-	329.352,670	1,62	1,18
	EMLAK KONUT GMYO	-	EKGYO.E	-	-	79.062,00	1,62	-	-	-	2,140	-	169.192,680	0,83	0,61
	ENERJİSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	ENJSA.E	-	-	20.621,00	7,67	-	-	-	12,510	-	257.968,710	1,27	0,93
	EREĞLİ DEMİR ÇELİK	-	EREGL.E	-	-	75.203,00	9,43	-	-	-	14,930	-	1.122.780,790	5,51	4,04
	FORD OTOSAN	-	FROTO.E	-	-	1.891,00	69,37	-	-	-	126,000	-	238.266,000	1,17	0,86
	T.GARANTİ BANKASI AŞ	-	GARAN.E	-	-	113.743,00	8,25	-	-	-	10,370	-	1.179.514,910	5,79	4,24
	GOOD-YEAR	-	GOODY.E	-	-	27.304,00	4,86	-	-	-	8,360	-	228.261,440	1,12	0,82
	T.HALK BANKASI AŞ	-	HALKB.E	-	-	10,00	5,40	-	-	-	5,560	-	55,600	0,00	0,00
	T.İŞ BANKASI AŞ	-	ISCTR.E	-	-	85.253,00	5,75	-	-	-	7,000	-	596.771,000	2,93	2,15
	İŞ Y. MEN. DEĞ.	-	ISMEN.E	-	-	40.119,00	7,26	-	-	-	17,660	-	708.501,540	3,48	2,55
	KAREL ELEKTRONİK	-	KARELE	-	-	13.108,00	15,16	-	-	-	23,060	-	302.270,480	1,48	1,09
	KOÇ HOLDİNG	-	KCHOLE	-	-	58.002,00	15,28	-	-	-	21,120	-	1.225.002,240	6,01	4,41
	KOZA MADENCİLİK	-	KOZAA.E	-	-	13.540,00	11,80	-	-	-	15,490	-	209.734,600	1,03	0,75
	KOZA ALTIN	-	KOZALE	-	-	6.485,00	72,34	-	-	-	96,700	-	627.099,500	3,08	2,26
	KARDEMİR	-	KRDMD.E	-	-	47.992,00	2,84	-	-	-	5,780	-	277.393,760	1,36	1,00
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVLE	-	-	3.893,00	40,23	-	-	-	52,200	-	203.214,600	1,00	0,73
	MİGROS TİCARET	-	MGROS.E	-	-	12.146,00	31,55	-	-	-	42,800	-	519.848,800	2,55	1,87
	PETKİM	-	PETKM.E	-	-	68.046,18	3,24	-	-	-	4,980	-	338.869,960	1,66	1,22
	SABANCI HOLDİNG	-	SAHOLE	-	-	56.544,00	8,72	-	-	-	11,460	-	647.994,240	3,18	2,33
	ŞİŞE CAM	-	SISE.E	-	-	116.030,91	5,94	-	-	-	7,310	-	848.185,970	4,16	3,05
	TURKCELL	-	TCELLE	-	-	74.117,00	14,24	-	-	-	16,100	-	1.193.283,700	5,85	4,29
	TEKFEN HOLDİNG	-	TKFEN.E	-	-	16.802,00	16,14	-	-	-	16,590	-	278.745,180	1,37	1,00
	TOFAŞ OTO. FAB.	-	TOASO.E	-	-	13.894,00	21,99	-	-	-	33,920	-	471.284,480	2,31	1,69
	TSKB	-	TSKB.E	-	-	10,00	2,41	-	-	-	1,780	-	17,800	0,00	0,00
	TÜRK TELEKOM	-	TTKOM.E	-	-	68.330,00	6,81	-	-	-	8,540	-	583.538,200	2,86	2,10
	TÜPRAŞ A.Ş.	-	TUPRS.E	-	-	8.030,00	97,60	-	-	-	108,000	-	867.240,000	4,25	3,12
	TÜRKİYE SİGORTA AŞ	-	TURSG.E	-	-	110.522,00	5,78	-	-	-	6,600	-	729.445,200	3,58	2,62

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

	ÜLKER BİSKÜVİ	-	ULKER.E	-	-	16.090,00	22,16	-	-	-	23,140	-	372.322,600	1,83	1,34
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	-	VAKBN.E	-	-	60.283,00	4,53	-	-	-	4,710	-	283.932,930	1,39	1,02
	VESTEL	-	VESTLE	-	-	17.336,00	15,43	-	-	-	21,060	-	365.096,160	1,79	1,31
	YATAŞ	-	YATAS.E	-	-	45.157,00	7,69	-	-	-	14,450	-	652.518,650	3,20	2,35
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	-	YKBNK.E	-	-	158.687,00	2,34	-	-	-	3,080	-	488.755,960	2,40	1,76
GRUP TOPLAMI						1.839.796,09							20.384.159,170	100,00	73,31
B.BORÇLANMA ARAÇLARI															
B.1. ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI															
Finansman Bonosu															
	AKBANK TAS	20.01.2021	TRFAKBK12148	15,35	19,00	140.000,00	94,57	-	16,51	-	99,205	-	138.887,480	3,92	0,50
	TÜRK EKONOMİ BANKASI AŞ	12.03.2021	TRFTEBK32123	9,43	70,00	140.000,00	100,00	-	9,76	-	100,538	-	140.752,460	3,98	0,51
	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	05.03.2021	TRFYAKF32130	18,44	63,00	400.000,00	96,76	-	19,90	-	96,908	-	387.631,350	10,95	1,39
ARA GRUP TOPLAMI						680.000,00							667.271,290	18,85	2,40
Tahvil															
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	14.09.2029	TRSVKFB92925	15,38	84,00	125.000,00	100,00	-	16,29	-	101,449	-	126.810,870	3,58	0,46
ARA GRUP TOPLAMI						125.000,00							126.810,870	3,58	0,46
B.2. KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI															
Devlet Tahvili															
	HAZİNE	02.03.2022	TRT020322T17	15,08	396,00	600.000,00	97,41	-	15,64	-	99,392	-	596.350,080	16,84	2,14
	HAZİNE	17.02.2021	TRT170221T12	14,13	47,00	1.890.000,00	100,08	-	15,03	-	103,463	-	1.955.446,620	55,23	7,03
	HAZİNE	18.01.2023	TRT180123T10	13,90	646,00	190.000,00	103,84	-	14,38	-	102,501	-	194.751,570	5,50	0,70
ARA GRUP TOPLAMI						2.680.000,00							2.746.548,270	77,57	9,88
GRUP TOPLAMI						3.485.000,00							3.540.630,430	100,00	12,73
C. TÜREV ARAÇLAR															
C.1. Nakit Teminatlar															
	-	-	TL	-	-	47.970,35	-	-	-	-	-	-	47.970,350	100,00	0,17
GRUP TOPLAMI						47.970,35							47.970,350	100,00	0,17
D. DİĞER VARLIKLAR															
D.1. Ters Repolar															
	-	04.01.2021	TRT080328T15	17,96	3,00	1.001.968,22	103,20	31.12.2020	19,65	968.983,00	103,252	-	1.000.491,690	24,79	3,60
	-	04.01.2021	TRT080328T15	11,42	3,00	370.463,06	103,20	31.12.2020	12,09	358.524,00	103,233	-	370.115,710	9,17	1,33
ARA GRUP TOPLAMI						1.372.431,28							1.370.607,400	33,96	4,93
D.2. Borsa Para Piyasası															
	-	04.01.2021	-	17,90	3,00	1.001.961,64	-	31.12.2020	19,58	-	-	-	1.000.490,410	24,79	3,60
ARA GRUP TOPLAMI						1.001.961,64							1.000.490,410	24,79	3,60
D.3. Vadeli Mevduat															
	AKBANK TAS	15.01.2021	3AyaKadarVD-AKB-TRY	17,00	14,00	566.615,19	-	11.12.2020	18,37	-	17,000	-	572.134,200	14,17	2,06
	TC ZİRAAT BANKASI AŞ	15.01.2021	3AyaKadarVD-TCZ-TRY	16,50	14,00	636.065,58	-	11.12.2020	17,79	-	16,500	-	642.079,410	15,91	2,31
ARA GRUP TOPLAMI						1.202.680,77							1.214.213,610	30,08	4,37
D.4. Katılma Payı															
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ	-	ZGOLD.F	-	-	6.549,00	39,90	-	-	-	45,150	-	295.687,350	7,33	1,06
	ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ	-	ZPLIB.F	-	-	10.159,00	14,30	-	-	-	15,290	-	155.331,110	3,85	0,56
ARA GRUP TOPLAMI						16.708,00							451.018,460	11,17	1,62
GRUP TOPLAMI						3.593.781,69							4.036.329,880	100,00	14,52
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ													28.009.089,830		100,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu")
31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2020			31 Aralık 2019		
	Tutar	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%	TL	%	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	28.009.090	100,00	100,73	8.956.049	100,00	100,92
B. HAZIR DEĞERLER	87	100,00	0,00	751	100,00	0,01
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	87	100,00	0,00	751	100,00	0,01
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	13.679		0,05	7.899	100,00	0,09
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	13.679	100,00	0,05	7.899	100,00	0,09
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	(216.888)	100,00	(0,78)	(90.721)	100,00	(1,02)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takasa Borçlar	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(18.552)	8,55	(0,07)	(5.838)	6,44	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Pay Geri Alışından Borçlar	(58.678)	27,05	(0,21)	-	-	-
h) SPK Kayda Alma Ücreti	(834)	0,38	(0,00)	-	-	-
ı) Diğer Borçlar	(138.824)	64,01	(0,50)	(84.883)	93,56	(0,96)
Fon Toplam Değeri	27.805.967		100,00	8.873.978		100,00
Toplam Katılma Payı/Pay Sayısı	100.000.000.000			100.000.000.000		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma Payı	98.173.412.287			99.244.860.033		
Fon toplam değeri (TL)	27.805.967			8.873.978		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	1.826.587.713			755.139.967		
Birim pay değeri (TL)	0,015223			0,011751		