

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS ATAK DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Atak 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 ATAK DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Atak 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 Atak Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun (eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Atak 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 ATAK DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Atak Değişken Emeklilik Yatırım Fonu")

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değeri	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A. PAY															
	AKBANK TAS	-	AKBNK.E	-	-	106619	6,156	-	-	-	6,93	-	738869,67	4,9908	2,7317
	AKSIGORTA	-	AKGRT.E	-	-	34728	7,12	-	-	-	9,3	-	322970,4	2,1816	1,1941
	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	AKSEN.E	-	-	19294	7,015	-	-	-	7,44	-	143547,36	0,9696	0,5307
	ARÇELİK	-	ARCLK.E	-	-	11194	20,818	-	-	-	30,4	-	340297,6	2,2986	1,2581
	ASELSAN	-	ASELS.E	-	-	29627	13,545	-	-	-	18,25	-	540692,75	3,6522	1,999
	AYGAZ	-	AYGAZ.E	-	-	9953	11,907	-	-	-	14,65	-	145811,45	0,9849	0,5391
	BİM MAĞAZALAR	-	BIMAS.E	-	-	9.615,00	61,21	-	-	-	75,500	-	725.932,500	4,90	2,68
	DOĞAN HOLDİNG	-	DOHOL.E	-	-	78.283,00	2,08	-	-	-	3,070	-	240.328,810	1,62	0,89
	EMLAK KONUT GMYO	-	EKGYO.E	-	-	59.466,00	1,60	-	-	-	2,140	-	127.257,240	0,86	0,47
	ENERJİSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	-	ENJSA.E	-	-	14.871,00	7,81	-	-	-	12,510	-	186.036,210	1,26	0,69
	EREĞLİ DEMİR ÇELİK	-	EREGL.E	-	-	54.537,00	9,34	-	-	-	14,930	-	814.237,410	5,50	3,01
	FORD OTOSAN	-	FROTO.E	-	-	1.372,00	70,48	-	-	-	126,000	-	172.872,000	1,17	0,64
	T.GARANTİ BANKASI AŞ	-	GARAN.E	-	-	82.100,00	8,26	-	-	-	10,370	-	851.377,000	5,75	3,15
	GOOD-YEAR	-	GOODY.E	-	-	19.838,00	4,90	-	-	-	8,360	-	165.845,680	1,12	0,61
	T.HALK BANKASI AŞ	-	HALKB.E	-	-	10,00	5,40	-	-	-	5,560	-	55,600	0,00	0,00
	T.İŞ BANKASI AŞ	-	ISCTR.E	-	-	62.079,00	5,67	-	-	-	7,000	-	434.553,000	2,94	1,61
	İŞ Y. MEN. DEĞ.	-	ISMEN.E	-	-	29.651,00	7,27	-	-	-	17,660	-	523.636,660	3,54	1,94
	KAREL ELEKTRONİK	-	KAREL.E	-	-	9.805,00	15,16	-	-	-	23,060	-	226.103,300	1,53	0,84
	KOÇ HOLDİNG	-	KCHOL.E	-	-	40.852,00	15,32	-	-	-	21,120	-	862.794,240	5,83	3,19
	KOZA MADENCİLİK	-	KOZAA.E	-	-	9.806,00	11,47	-	-	-	15,490	-	151.894,940	1,03	0,56
	KOZA ALTIN	-	KOZAL.E	-	-	4.674,00	73,15	-	-	-	96,700	-	451.975,800	3,05	1,67
	KARDEMİR	-	KRDMD.E	-	-	36.103,00	2,82	-	-	-	5,780	-	208.675,340	1,41	0,77
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVLE	-	-	2.862,00	39,63	-	-	-	52,200	-	149.396,400	1,01	0,55
	MİGROS TİCARET	-	MGROS.E	-	-	8.912,00	32,26	-	-	-	42,800	-	381.433,600	2,58	1,41
	PETKİM	-	PETKM.E	-	-	49.429,96	3,22	-	-	-	4,980	-	246.161,200	1,66	0,91
	SABANCI HOLDİNG	-	SAHOL.E	-	-	40.152,00	8,71	-	-	-	11,460	-	460.141,920	3,11	1,70
	ŞİŞE CAM	-	SISE.E	-	-	84.183,15	5,94	-	-	-	7,310	-	615.378,800	4,16	2,28
	TURKCELL	-	TCELL.E	-	-	53.626,00	14,23	-	-	-	16,100	-	863.378,600	5,83	3,19
	TEKFEN HOLDİNG	-	TKFEN.E	-	-	12.216,00	15,95	-	-	-	16,590	-	202.663,440	1,37	0,75
	TOFAŞ OTO. FAB.	-	TOASO.E	-	-	10.082,00	21,99	-	-	-	33,920	-	341.981,440	2,31	1,26
	TSKB	-	TSKB.E	-	-	10,00	2,41	-	-	-	1,780	-	17,800	0,00	0,00
	TÜRK TELEKOM	-	TTKOM.E	-	-	50.006,00	6,85	-	-	-	8,540	-	427.051,240	2,88	1,58
	TÜPRAŞ A.Ş.	-	TUPRS.E	-	-	5.868,00	96,63	-	-	-	108,000	-	633.744,000	4,28	2,34
	TÜRKİYE SİGORTA AŞ	-	TURSG.E	-	-	79.816,00	5,75	-	-	-	6,600	-	526.785,600	3,56	1,95

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

	ÖLKER BİSKÜVİ	-	ULKER.E	-	-	11.898,00	22,15	-	-	-	23,140	-	275.319,720	1,86	1,02
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	-	VAKBN.E	-	-	43.851,00	4,54	-	-	-	4,710	-	206.538,210	1,40	0,76
	VESTEL	-	VESTLE	-	-	12.561,00	15,28	-	-	-	21,060	-	264.534,660	1,79	0,98
	YATAŞ	-	YATAS.E	-	-	33.136,00	7,91	-	-	-	14,450	-	478.815,200	3,23	1,77
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	-	YKBNK.E	-	-	115.413,00	2,34	-	-	-	3,080	-	355.472,040	2,40	1,31
GRUP TOPLAMI						1.338.499,11							14.804.578,830	100,00	54,73
B.BORÇLANMA ARAÇLARI															
B.1. ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI															
Finansman Bonosu															
	AKBANK TAS	05.01.2021	TRFAKBK12122	17,88	4,00	450.000,00	94,78	-	19,55	-	99,804	-	449.117,780	4,49	1,66
	AKBANK TAS	21.01.2021	TRFAKBK12197	18,08	20,00	150.000,00	99,42	-	19,66	-	99,774	-	149.661,140	1,50	0,55
	DENİZBANK A.Ş.	12.02.2021	TRFDZBK22115	12,48	42,00	400.000,00	94,77	-	13,19	-	98,581	-	394.323,010	3,95	1,46
	QNB Finans Finansal Kiralama	16.02.2021	TRFFFKR22126	15,80	46,00	500.000,00	96,16	-	16,93	-	98,043	-	490.213,730	4,91	1,81
	GARANTİ FAKTORİNG	22.01.2021	TRFGRFA12118	8,35	21,00	400.000,00	95,71	-	8,69	-	99,521	-	398.081,980	3,98	1,47
	Garanti Finansal Kiralama	04.02.2021	TRFGRFK22116	15,18	34,00	500.000,00	96,34	-	16,27	-	98,602	-	493.010,220	4,93	1,82
	Koç Fiat Kredi Finansman	13.04.2021	TRFKFTP42112	17,53	102,00	500.000,00	94,52	-	18,66	-	95,319	-	476.595,060	4,77	1,76
	NUROL YATIRIM BANKASI AŞ	23.02.2021	TRFNURL22127	16,30	53,00	500.000,00	95,80	-	17,47	-	97,682	-	488.411,400	4,89	1,81
	NUROL YATIRIM BANKASI AŞ	04.03.2021	TRFNURL32118	18,44	62,00	150.000,00	95,93	-	19,91	-	96,954	-	145.431,530	1,46	0,54
	NUROL YATIRIM BANKASI AŞ	08.04.2021	TRFNURL42117	17,92	97,00	400.000,00	95,08	-	19,13	-	95,443	-	381.773,610	3,82	1,41
	TÜRK EKONOMİ BANKASI AŞ	05.03.2021	TRFTEBK32115	18,50	63,00	400.000,00	100,00	-	19,83	-	99,204	-	396.816,590	3,97	1,47
	TÜRK EKONOMİ BANKASI AŞ	19.03.2021	TRFTEBK32131	18,00	77,00	150.000,00	100,00	-	19,25	-	98,618	-	147.927,620	1,48	0,55
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	22.01.2021	TRFYKBK12114	18,44	21,00	400.000,00	94,86	-	20,13	-	98,948	-	395.789,830	3,96	1,46
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	15.01.2021	TRFYKBK12122	14,82	14,00	300.000,00	95,43	-	15,93	-	99,433	-	298.299,590	2,98	1,10
ARA GRUP TOPLAMI						5.200.000,00							5.105.453,090	51,09	18,88
Tahvil															
	İŞ GMYO	23.03.2021	TRISISGY32111	15,79	81,00	400.000,00	100,01	-	16,75	-	100,486	-	401.944,100	4,02	1,49
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	14.09.2029	TRSVKFB92925	15,38	84,00	175.000,00	100,00	-	16,29	-	101,449	-	177.535,220	1,78	0,66
ARA GRUP TOPLAMI						575.000,00							579.479,320	5,80	2,14
B.2. KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI															
Devlet Tahvili															
	HAZINE	02.03.2022	TRT020322T17	15,08	396,00	1.000.000,00	97,41		15,64		99,392		993.916,800	9,95	3,67
	HAZINE	14.09.2022	TRT140922T17	14,27	575,00	1.000.000,00	94,38		14,78	-	93,986	-	939.855,910	9,40	3,47
	HAZINE	17.02.2021	TRT170221T12	14,13	47,00	1.800.000,00	99,62		15,03	-	103,463	-	1.862.330,110	18,64	6,89
	HAZINE	18.01.2023	TRT180123T10	13,90	646,00	500.000,00	103,84		14,38	-	102,501	-	512.504,140	5,13	1,89
ARA GRUP TOPLAMI						4.308.000,00							4.308.606,960	43,11	15,93
GRUP TOPLAMI						10.075.000,00							9.993.539,370	100,00	36,95

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

C. TÜREV ARAÇLAR

C.1. Nakit Teminatlar

	-	-	TL	-	-	47.970,35	-	-	-	-	-	-	47.970,350	100,00	0,18
GRUP TOPLAMI						47.970,35							47.970,350	100,00	0,18

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	40,85	3,70
	-	04.01.2021	TRT080328T15	11,42	3,00	340.425,51	103,20	31.12.2020	12,09	329.454,00	103,233	-	340.106,330	13,89	1,26
ARA GRUP TOPLAMI						1.342.393,73							1.340.598,020	54,73	4,96

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	40,85	3,70
ARA GRUP TOPLAMI						1.001.961,64							1.000.490,410	40,85	3,70

D.3. Katılma Payı

ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ AŞ	-	ZPLIB.F	-	-	7.084,00	14,29	-	-	-	15,290	-	108.314,360	4,42	0,40
ARA GRUP TOPLAMI					7.084,00							108.314,360	4,42	0,40

GRUP TOPLAMI						2.351.439,37							2.449.402,790	100,00	9,06
---------------------	--	--	--	--	--	---------------------	--	--	--	--	--	--	----------------------	---------------	-------------

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ													27.295.491,340		100,00
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-----------------------	--	---------------

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS ATAK DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Atak 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	27.295.491	100,00	100,92	11.564.388	100,00	100,64
B. HAZIR DEĞERLER	2.780	100,00	0,01	494	100,00	0,00
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	2.780	100,00	0,01	494	100,00	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	13.384	100,00	0,05	10.132	100,00	0,09
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	13.384	100,00	0,05	10.132	100,00	0,09
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	(263.761)	100,00	(0,98)	(84.235,00)	100,00	(0,73)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takasa Borçlar	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(18.376)	6,97	(0,07)	(7.567,00)	8,98	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Pay Geri Alışından Borçlar	(92.213)	34,96	(0,34)	-	-	-
h) SPK Kayda Alma Ücreti	(811)	0,31	(0,00)	-	-	-
ı) Diğer Borçlar	(152.361)	57,76	(0,56)	(76.668,00)	91,02	(0,67)
Fon Toplam Değeri	27.047.895		100,00	11.490.779		100,00
Toplam Katılma Payı/Pay Sayısı	100.000.000.000			100.000.000.000		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma Payı	98.268.426.149			99.090.852.649		
Fon toplam değeri (TL)	27.047.895			11.490.779		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	1.731.573.851			909.147.351		
Birim pay değeri (TL)	0,015620			0,012639		