

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli 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 TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli 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 Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun (eski adıyla “Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli 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 TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli 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.BORÇLANMA ARAÇLARI															
A.1. ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI															
Finansman Bonosu															
	AKBANK TAS	21.01.2021	TRFAKBK12197	18,08	20,00	70.000	99,415	-	19,66	-	99,774	-	69.841,870	1,54	0,99
	AKBANK TAS	02.02.2021	TRFAKBK22139	14,85	32,00	200.000	94,523	-	15,90	-	98,711	-	197.421,830	4,35	2,81
	AK YATIRIM	20.04.2021	TRFAKYM42127	17,33	25,00	200.000	99,997	-	18,79	-	100,229	-	200.457,090	4,42	2,85
	DENİZBANK A.Ş.	10.06.2021	TRFDZBK62111	18,94	160,00	150.000	91,346	-	19,96	-	92,313	-	138.469,700	3,05	1,97
	NUROL YATIRIM BANKASI AŞ	05.02.2021	TRFNURL22119	15,52	35,00	150.000	96,222	-	16,65	-	98,530	-	147.794,520	3,26	2,10
	NUROL YATIRIM BANKASI AŞ	08.04.2021	TRFNURL42117	17,92	97,00	100.000	95,077	-	19,13	-	95,443	-	95.443,400	2,10	1,36
	T.VAKIFLAR BANKASI TAO	12.02.2021	TRFVKFB22143	14,04	42,00	150.000	100,000	-	14,80	-	102,144	-	153.215,790	3,38	2,18
	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	04.03.2021	TRFYAKF32114	16,74	62,00	250.000	96,000	-	17,95	-	97,227	-	243.067,480	5,36	3,46
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	22.01.2021	TRFYKBK12114	18,44	21,00	100.000	95,425	-	20,13	-	98,948	-	98.947,460	2,18	1,41
ARA GRUP TOPLAMI						1.370.000							1.344.659,140	29,65	19,15
Tahvil															
	HEKTAŞ	10.03.2021	TRSHEKT32123	17,77	68,00	40.000	100,091	-	18,99	-	101,102	-	40.440,740	0,89	0,58
	MİGROS TİCARET	24.02.2021	TRSMGTI22115	18,25	54,00	40.000	100,003	-	19,53	-	102,196	-	40.878,350	0,90	0,58
	T.İŞ BANKASI AŞ	07.02.2022	TRSTISB22212	14,36	38,00	200.000	99,619	-	15,16	-	102,276	-	204.552,840	4,51	2,91
	YAPI KREDİ BANKASI AŞ	11.03.2021	TRSYKBK32115	22,12	69,00	200.000	100,000	-	23,97	-	101,568	-	203.135,050	4,48	2,89
ARA GRUP TOPLAMI						480.000							489.006,980	10,78	6,96
A.2. KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI															
Devlet Tahvili															
	HAZİNE	14.04.2021	TRT140421T13	14,76	103,00	500.000,00	88,76	-	15,55	-	95,99	-	479.960,57	10,58	6,83
	HAZİNE	17.02.2021	TRT170221T12	14,13	47,00	1.650.000,00	101,21	-	15,03	-	103,46	-	1.707.135,94	37,64	24,31
	HAZİNE	26.01.2022	TRT260122T11	15,27	26,00	500.000,00	99,77	-	16,17	-	103,00	-	514.995,70	11,35	7,33
ARA GRUP TOPLAMI						2.650.000							2.702.092,210	59,57	38,48
GRUP TOPLAMI						4.500.000							4.535.758,330	100,00	64,59
B. KİRA SERTİFİKALARI															
	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	24.02.2021	TRDZKVK22139	17,09	54,00	150.000,00	100,00	-	18,18	-	101,46	-	152.192,15	100,00	2,17
GRUP TOPLAMI						150.000							152.192,150	100,00	2,17
C. DİĞER VARLIKLAR															
C.1. Borsa Para Piyasası															
	-	05.01.2021	-	18,10	4,00	501.239,73	-	31.12.2020	19,81	-	-	-	500.247,70	21,51	7,12
	-	04.01.2021	-	17,70	3,00	90.174,58	-	31.12.2020	19,34	-	-	-	90.043,64	3,87	1,28
ARA GRUP TOPLAMI						591.414							590.291,340	25,38	8,41

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

C.2. Vadeli Mevduat

ANADOLUBANKI A.Ş.	19.01.2021	3AyaKadarVD-ADB-TRY	17,00	18,00	328.459	-	15.12.2020	18,37	-	17,000	-	331.048,970	14,24	4,71
AKBANK TAS	03.02.2021	3AyaKadarVD-AKB-TRY	18,75	33,00	100.000	-	30.12.2020	20,42	-	18,750	-	100.106,150	4,30	1,43
TÜRK EKONOMİ BANKASI AŞ	19.01.2021	3AyaKadarVD-TEB-TRY	17,40	18,00	270.851	-	15.12.2020	18,83	-	17,400	-	273.036,910	11,74	3,89
T.HALK BANKASI AŞ	01.02.2021	3AyaKadarVD-THL-TRY	17,50	31,00	301.882	-	28.12.2020	18,95	-	17,500	-	302.466,980	13,01	4,31
T.HALK BANKASI AŞ	19.01.2021	3AyaKadarVD-THL-TRY	16,75	18,00	53.656	-	15.12.2020	18,08	-	16,750	-	54.072,950	2,33	0,77
T.VAKIFLAR BANKASI TAO	05.01.2021	3AyaKadarVD-TVB-TRY	16,00	4,00	102.379	-	04.12.2020	17,22	-	16,000	-	103.631,300	4,46	1,48
T.VAKIFLAR BANKASI TAO	05.01.2021	3AyaKadarVD-TVB-TRY	15,50	4,00	231.729	-	30.11.2020	16,63	-	15,500	-	234.867,960	10,10	3,34
ARA GRUP TOPLAMI					1.388.955							1.399.231,220	60,17	19,93

C.3. Katılım Hesabı

ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	19.01.2021	3AyaKadarVD-ZTB-TRY	16,75	18,00	107.237		16.12.2020	16,75		16,750		108.024,350	4,65	1,54
ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	19.01.2021	3AyaKadarVD-ZTB-TRY	15,25	18,00	226.257		15.12.2020	15,25		15,250		227.864,390	9,80	3,24
ARA GRUP TOPLAMI					333.494							335.888,740	14,44	4,78
GRUP TOPLAMI					2.313.864							2.325.411,300	100,00	33,11
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ												7.013.361,780		100,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ZEM OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla "Ziraat Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli 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 TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	7.013.362	100,00	99,87	3.973.952	100,00	100,71
B. HAZIR DEĞERLER	8.051	100,00	0,11	371	100,00	0,01
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	8.051	100,00	0,11	371	100,00	0,01
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	11.531	100,00	0,16	7.290	100,00	0,18
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	11.531	100,00	0,16	7.290	100,00	0,18
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E.BORÇLAR	(10.535)	100,00	(0,15)	(35.509)	100,00	(0,90)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takasa Borçlar	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(4.948)	46,96	(0,07)	(2.680)	7,55	(0,07)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Pay Geri Alışından Borçlar	(692)	6,57	(0,01)	-	-	-
h) SPK Kayda Alma Ücreti	(211)	2,00	(0,00)	-	-	-
i) Diğer Borçlar	(4.684)	44,46	(0,07)	(32.829)	92,45	(0,83)
Fon Toplam Değeri	7.022.408	100,00		3.946.104		100,00
Toplam Katılma Payı/Pay Sayısı	100.000.000.000			100.000.000.000		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma Payı	99.543.350.369			99.715.612.935		
Fon toplam değeri (TL)	7.022.408			3.946.104		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	456.649.631			284.387.065		
Birim pay değeri (TL)	0,015378			0,013876		