

AXA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM 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



**AXA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ 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**

Axa Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Dengeli 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 İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Axa Hayat ve Emeklilik A.Ş. OKS Dengeli 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 İlişkin 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 Axa 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, 28 Nisan 2021

AXA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

			Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Günlük					
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	İzleşme	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	F.T.D.
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	No	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	(%)
A.HİSSE SENEDİ																	
Hisse Senetleri	AEFES		AEFES			34,00	20,600000	12/1/2020				23,18	1,00	788,12	0,01	0,01	0,01
	AGHOL		AGHOL			37,00	19,090000	11/3/2020				26,42	1,00	977,54	0,02	0,01	0,01
	AKBNK		AKBNK			548,00	5,970000	12/24/2020				6,93	1,00	3.797,64	0,07	0,03	0,03
	AKGRT		AKGRT			91,00	7,020000	11/3/2020				9,30	1,00	846,30	0,02	0,01	0,01
	ALARK		ALARK			28,00	5,370000	11/3/2020				8,64	1,00	241,92	0,00	0,00	0,00
	ALKA		ALKA			24,00	13,900000	11/3/2020				14,00	1,00	336,00	0,01	0,00	0,00
	ANHYT		ANHYT			10,00	8,620000	12/31/2020				8,67	1,00	86,70	0,00	0,00	0,00
	ARCLK		ARCLK			48,00	26,850000	12/28/2020				30,40	1,00	1.459,20	0,03	0,01	0,01
	ARDYZ		ARDYZ			10,00	36,480000	11/9/2020				48,08	1,00	480,80	0,01	0,00	0,00
	ASELS		ASELS			65,00	17,470000	12/30/2020				18,25	1,00	1.186,25	0,02	0,01	0,01
	AYGAZ		AYGAZ			20,00	11,410000	11/11/2020				14,65	1,00	293,00	0,01	0,00	0,00
	BIMAS		BIMAS			29,00	64,490000	12/30/2020				75,50	1,00	2.189,50	0,04	0,02	0,02
	CCOLA		CCOLA			7,00	52,570000	12/30/2020				65,80	1,00	460,60	0,01	0,00	0,00
	DOHOL		DOHOL			55,00	2,590000	12/2/2020				3,07	1,00	168,85	0,00	0,00	0,00
	ENJSA		ENJSA			37,00	10,980000	12/11/2020				12,51	1,00	462,87	0,01	0,00	0,00
	EREGL		EREGL			248,00	9,130000	11/30/2020				14,93	1,00	3.702,64	0,07	0,03	0,03
	FONET		FONET			37,00	12,220000	12/23/2020				13,03	1,00	482,11	0,01	0,00	0,00
	FROTO		FROTO			3,00	102,910000	12/2/2020				126,00	1,00	378,00	0,01	0,00	0,00
	GARAN		GARAN			339,00	7,940000	11/11/2020				10,37	1,00	3.515,43	0,06	0,03	0,02
	ISCTR		ISCTR			256,00	5,930000	11/26/2020				7,00	1,00	1.792,00	0,03	0,01	0,01
	KCHOL		KCHOL			167,00	16,210000	12/30/2020				21,12	1,00	3.527,04	0,06	0,03	0,02
	KORDS		KORDS			20,00	11,180000	11/3/2020				15,55	1,00	311,00	0,01	0,00	0,00
	KOZAA		KOZAA			17,00	12,080000	12/4/2020				15,49	1,00	263,33	0,00	0,00	0,00
	KOZAL		KOZAL			9,00	76,280000	11/3/2020				96,70	1,00	870,30	0,02	0,01	0,01
	KRDMD		KRDMD			324,00	5,140000	12/28/2020				5,78	1,00	1.872,72	0,03	0,01	0,01
	KRVGD		KRVGD			38,00	13,310000	12/25/2020				13,22	1,00	502,36	0,01	0,00	0,00
	LOGO		LOGO			4,00	99,490000	11/26/2020				125,50	1,00	502,00	0,01	0,00	0,00
	MAVI		MAVI			10,00	37,280000	9/30/2020				52,20	1,00	522,00	0,01	0,00	0,00

AXA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM 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 Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Iskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)
	MGROS		MGROS			38,00	34,900000	12/1/2020				42,80	1,00	1.626,40	0,03	0,01	0,01
	OYAKC		OYAKC			21,00	7,870000	11/9/2020				8,78	1,00	184,38	0,00	0,00	0,00
	PETKM		PETKM			275,60	3,810000	11/27/2020				4,98	1,00	1.372,49	0,03	0,01	0,01
	PGSUS		PGSUS			5,00	59,780000	12/7/2020				74,60	1,00	373,00	0,01	0,00	0,00
	SAHOL		SAHOL			119,00	8,470000	11/3/2020				11,46	1,00	1.363,74	0,03	0,01	0,01
	SISE		SISE			319,43	6,670000	12/9/2020				7,31	1,00	2.335,03	0,04	0,02	0,02
	SOKM		SOKM			13,00	12,630000	12/1/2020				12,62	1,00	164,06	0,00	0,00	0,00
	TAVHL		TAVHL			19,00	17,410000	11/20/2020				21,30	1,00	404,70	0,01	0,00	0,00
	TCELL		TCELL			245,00	14,850000	12/16/2020				16,10	1,00	3.944,50	0,07	0,03	0,03
	THYAO		THYAO			33,00	11,060000	12/7/2020				12,91	1,00	426,03	0,01	0,00	0,00
	TKFEN		TKFEN			45,00	15,530000	12/25/2020				16,59	1,00	746,55	0,01	0,01	0,01
	TOASO		TOASO			41,00	27,300000	11/24/2020				33,92	1,00	1.390,72	0,03	0,01	0,01
	TSKB		TSKB			95,00	1,920000	12/24/2020				1,78	1,00	169,10	0,00	0,00	0,00
	TTKOM		TTKOM			178,00	7,190000	12/15/2020				8,54	1,00	1.520,12	0,03	0,01	0,01
	TUPRS		TUPRS			21,00	86,830000	11/26/2020				108,00	1,00	2.268,00	0,04	0,02	0,02
	TURSG		TURSG			165,00	6,060000	12/28/2020				6,60	1,00	1.089,00	0,02	0,01	0,01
	ULKER		ULKER			19,00	22,820000	12/24/2020				23,14	1,00	439,66	0,01	0,00	0,00
	VAKBN		VAKBN			85,00	4,110000	11/4/2020				4,71	1,00	400,35	0,01	0,00	0,00
	YATAS		YATAS			52,00	9,680000	12/9/2020				14,45	1,00	751,40	0,01	0,01	0,01
	YKBNK		YKBNK			476,00	2,580000	12/9/2020				3,08	1,00	1.466,08	0,03	0,01	0,01
ARA GRUP TOPLAMI						4.780,03								54.451,53		0,41	0,38
GRUP TOPLAMI						4.780,03								54.451,53		0,41	0,38
B. BORÇLANMA SENETLERİ																	
Devlet Tahvili	T.C.	2/17/2021	TRT170221T12	0,05	2	3.000,00	101,760630	12/14/2020	0,20			103,58	1,00	3.107,47	0,07	0,02	0,02
	T.C.	4/14/2021	TRT140421T13	0,00		8.000,00	92,781200	12/18/2020	0,15			96,11	1,00	7.688,52	0,18	0,06	0,05
	T.C.	4/14/2021	TRT140421T13	0,00		7.000,00	95,953710	12/31/2020	0,15			96,11	1,00	6.727,46	0,15	0,05	0,05
	T.C.	4/21/2021	TRT210421T14	0,10	2	10.000,00	104,663500	12/9/2020	0,55			105,88	1,00	10.588,40	0,24	0,08	0,07
	T.C.	10/20/2021	TRT201021T25	0,07	2	2.000,00	108,685500	6/23/2020	0,02			101,46	1,00	2.029,19	0,05	0,02	0,01
	T.C.	5/4/2022	TRT040522T13	0,09	2	2.000,00	94,594500	12/1/2020	0,11			94,72	1,00	1.894,40	0,04	0,01	0,01
	T.C.	9/14/2022	TRT140922T17	0,04	2	3.000,00	95,871330	10/9/2020	0,06			94,09	1,00	2.822,77	0,06	0,02	0,02
	T.C.	1/18/2023	TRT180123T10	0,06	2	3.000,00	100,793200	4/6/2020	0,02			102,61	1,00	3.078,43	0,07	0,02	0,02
	T.C.	7/24/2024	TRT240724T15	0,05	2	2.000,00	90,913250	12/22/2020	0,03			92,71	1,00	1.854,21	0,04	0,01	0,01
	T.C.	2/11/2026	TRT110226T13	0,05	2	3.000,00	94,385950	12/15/2020	0,02			97,23	1,00	2.917,04	0,07	0,02	0,02
	T.C.	3/8/2028	TRT080328T15	0,06	2	1.000,00	100,746000	5/20/2020	0,00			103,00	1,00	1.029,99	0,02	0,01	0,01
ARA GRUP TOPLAMI						44.000,00								43.737,88		0,33	0,30

AXA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM 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 Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oran	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)
FINANSMAN BONOSU	QNB FİNANSBANK A.Ş.	4/2/2021	TRFFNBK42114	0,02	12	10.000,00	100,195000	12/2/2020	0,05			100,69	1,00	10.068,80	0,51	0,08	0,07
	İŞ FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	2/24/2021	TRFISFN22114	0,00		10.000,00	96,412100	12/1/2020	0,16			97,83	1,00	9.783,15	0,49	0,07	0,07
ARA GRUP TOPLAMI						20.000,00								19.851,95		0,15	0,14
GRUP TOPLAMI						64.000,00								63.589,83		0,48	0,44
K.BORSA PAR A PİYASASI																	
BPP		1/5/2021		0,18		6.031,64	100.000,000000	12/25/2020	0,20			100.327,83	1,00	6.019,67	0,55	0,05	0,04
		1/5/2021		0,18		5.019,73	100.000,000000	12/28/2020	0,20			100.195,40	1,00	5.009,77	0,45	0,04	0,03
ARA GRUP TOPLAMI						11.051,37								11.029,44		0,08	0,08
GRUP TOPLAMI						11.051,37								11.029,44		0,08	0,08
M. TEMİNAT İŞLEMLERİ																	
VIOP Nakit						2.473,46	1,000000	3/5/2020				1,00	1,00	2.473,46	1,00	0,02	0,02
ARA GRUP TOPLAMI						2.473,46								2.473,46		0,02	0,02
GRUP TOPLAMI						2.473,46								2.473,46		0,02	0,02
FON PORTFÖY DEĞERİ						82.304,86								131.544,26			
VIOP SÖZLEŞMESİ																	
Uzun Pozisyon	Uzun	2/26/2021	F_XAUTRYM0221			10,00	465,630000	12/31/2020				466,19	1,00	4.661,90	1,00	0,04	0,03
TOPLAMI						10,00								4.661,90		0,04	0,03
Grup Toplamı														4.661,90			
TOPLAMI						10,00								4.661,90			

AXA HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM 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	131.544		91,32	49.932		81,94
B.HAZIR DEĞERLER	1.056		0,73	2.024		3,32
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	1.056	100,00	0,73	2.024	100,00	3,32
C.ALACAKLAR	13.954		9,69	13.326		21,87
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	2.819	21,16	4,63
b) Takastan Alacaklar T2	2.016	14,44	1,40	1.555	11,67	2,55
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	11.939	85,56	8,29	8.952	67,18	14,69
D.DİĞER VARLIKLAR	-		-	-		-
E.BORÇLAR	(2.508)		(1,74)	(4.348)		(7,13)
a) Takasa Borçlar T1	(1.128)	44,97	(0,78)	(3.515)	80,85	(5,76)
b) Takasa Borçlar T2	(86)	3,44	(0,06)	(41)	0,93	(0,07)
c) Yönetim Ücreti	(95)	3,80	(0,07)	(52)	1,19	(0,09)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(1.199)	47,79	(0,83)	(740)	17,02	(1,21)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-		-	-		-
Fon Toplam Değeri	144.046		100,00	60.934		100,00