

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATKI 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



**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATKI 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. Katkı 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 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Katkı 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 2021

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-3
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	4

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI 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	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENEDİ															
	T.C.	-	AKBNK	-	-	1.080.000,00	6,10692	25.12.2020	-	-	6,93	1,00	7.484.400,00	6,33	0,92
	T.C.	-	ARCLK	-	-	221.500,00	26,13467	25.12.2020	-	-	30,40	1,00	6.733.600,00	5,70	0,83
	T.C.	-	ASELS	-	-	355.000,00	12,38645	25.12.2020	-	-	18,25	1,00	6.478.750,00	5,48	0,80
	T.C.	-	BIMAS	-	-	96.500,00	50,09192	25.12.2020	-	-	75,50	1,00	7.285.750,00	6,16	0,90
	T.C.	-	EREGL	-	-	535.000,00	9,15568	25.12.2020	-	-	14,93	1,00	7.987.550,00	6,76	0,98
	T.C.	-	GARAN	-	-	705.000,00	8,11659	25.12.2020	-	-	10,37	1,00	7.310.850,00	6,18	0,90
	T.C.	-	ISCTR	-	-	1.050.000,00	5,35484	25.12.2020	-	-	7,00	1,00	7.350.000,00	6,22	0,90
	T.C.	-	KCHOL	-	-	355.000,00	16,97156	25.12.2020	-	-	21,12	1,00	7.497.600,00	6,34	0,92
	T.C.	-	KRDMD	-	-	1.321.500,00	3,98302	25.12.2020	-	-	5,78	1,00	7.638.270,00	6,46	0,94
	T.C.	-	PETKM	-	-	1.550.000,00	5,02155	30.12.2020	-	-	4,98	1,00	7.719.000,00	6,53	0,95
	T.C.	-	PGSUS	-	-	107.500,00	74,42230	31.12.2020	-	-	74,60	1,00	8.019.500,00	6,78	0,99
	T.C.	-	SISE	-	-	1.092.500,59	5,13193	25.12.2020	-	-	7,31	1,00	7.986.179,31	6,76	0,98
	T.C.	-	TCELL	-	-	449.002,00	13,43626	25.12.2020	-	-	16,10	1,00	7.228.932,20	6,11	0,89
	T.C.	-	THYAO	-	-	0,50	12,55178	10.03.2020	-	-	12,91	1,00	6,46	0,00	0,00
	T.C.	-	TOASO	-	-	230.000,00	33,55345	31.12.2020	-	-	33,92	1,00	7.801.600,00	6,60	0,96
	T.C.	-	TUPRS	-	-	74.500,00	86,30642	25.12.2020	-	-	108,00	1,00	8.046.000,00	6,81	0,99
	T.C.	-	YKBNK	-	-	1.835.000,00	3,07471	25.12.2020	-	-	3,08	1,00	5.651.800,00	4,78	0,70
GRUP TOPLAMI						11.058.003,09							118.219.787,97		14,55
BANKA BONOSU															
	HSBC BANK A.Ş.	05.05.2021	TRFHSBC52115	-	-	5.590.000,00	92,05500	07.10.2020	19,42	-	94,29	1,00	5.270.544,92	0,80	0,65
	Türk Ekonomi Bankası	26.02.2021	TRFTEBK22140	-	-	5.000.000,00	94,08600	02.07.2020	18,26	-	97,59	1,00	4.879.698,50	0,74	0,60
	Türk Ekonomi Bankası	12.03.2021	TRFTEBK32123	2,35	3	4.000.000,00	99,06725	08.10.2020	9,76	-	100,61	1,00	4.024.579,61	0,61	0,50
	Türkiye Garanti Bankası	14.02.2030	TRSGRAN23013	3,25	3	2.100.000,00	100,00000	14.02.2020	-	-	105,33	1,00	2.211.885,90	0,33	0,27
	Türkiye Garanti Bankası	07.10.2029	TRSGRANE2915	4,49	3	3.000.000,00	100,00000	01.01.2020	0,05	-	104,03	1,00	3.120.961,29	0,47	0,38
ARA GRUP TOPLAMI						19.690.000,00							19.507.670,22		2,40

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI 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 İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.	01.10.2025	TRT011025T16	6,30	6	11.000.000,00	96,37552	03.11.2020	0,77	-	102,49	1,00	11.273.589,35	1,70	1,39
	T.C.	02.03.2022	TRT020322T17	5,50	6	2.000.000,00	98,17637	02.04.2020	5,18	-	99,51	1,00	1.990.216,34	0,30	0,24
	T.C.	08.03.2023	TRT080323T10	3,55	6	27.500.000,00	77,08460	09.04.2020	6,71	-	89,92	1,00	24.727.792,40	3,73	3,04
	T.C.	08.03.2028	TRT080328T15	6,20	6	49.300.000,00	97,78858	09.11.2020	0,43	-	103,00	1,00	50.778.354,32	7,66	6,25
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	5,30	6	132.100.000,00	82,30413	25.11.2020	1,57	-	97,23	1,00	128.447.020,73	19,38	15,80
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	5,25	6	73.500.000,00	89,07674	04.11.2020	1,52	-	95,24	1,00	70.002.525,06	10,56	8,61
	T.C.	12.03.2025	TRT120325T12	4,00	6	50.800.000,00	70,57529	21.01.2020	4,40	-	86,85	1,00	44.119.453,24	6,66	5,43
	T.C.	13.11.2030	TRT131130T14	5,85	6	7.000.000,00	96,89668	29.12.2020	0,92	-	96,69	1,00	6.768.574,24	1,02	0,83
	T.C.	14.06.2023	TRT140623T19	8,10	6	40.500.000,00	100,43199	15.10.2020	1,03	-	105,42	1,00	42.696.618,51	6,44	5,25
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	6,10	6	15.100.000,00	94,88212	29.07.2020	1,65	-	102,61	1,00	15.494.773,34	2,34	1,91
	T.C.	18.10.2023	TRT181023T19	10,05	6	16.800.000,00	113,44978	05.05.2020	0,00	-	119,34	1,00	20.049.218,73	3,02	2,47
	T.C.	20.03.2024	TRT200324T13	5,20	6	52.900.000,00	75,53331	26.10.2020	3,16	-	95,21	1,00	50.368.634,70	7,60	6,20
	T.C.MERKEZ BANKASI	20.10.2021	TRT201021T25	6,90	6	13.681.603,00	106,62987	06.11.2020	6,82	-	101,46	1,00	13.881.311,50	2,09	1,71
	T.C.	24.02.2027	TRT240227T17	5,50	6	53.500.000,00	87,02870	18.12.2020	1,36	-	97,11	1,00	51.955.463,61	7,84	6,39
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	4,50	6	57.030.000,00	63,99953	01.01.2020	3,43	-	92,71	1,00	52.872.809,96	7,98	6,51
	T.C.	27.09.2023	TRT270923T11	4,40	6	35.100.000,00	73,11605	28.12.2020	5,01	-	91,36	1,00	32.066.363,65	4,84	3,95
ARA GRUP TOPLAMI						637.811.603,00							617.492.719,68		75,98
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ															
	TÜRKİYE İŞ BANKASI	13.09.2029	TRSTISB92918	4,01	3	6.500.000,00	100,00000	01.01.2020	0,48	-	100,05	1,00	6.503.315,92	0,98	0,80
	Türkiye Vakıflar Bankası	14.09.2029	TRSVKFB92925	3,90	3	6.500.000,00	100,00000	01.01.2020	0,32	-	101,57	1,00	6.602.358,61	1,00	0,81
	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2029	TRSYKKB62914	6,36	3	1.800.000,00	100,00000	01.01.2020	0,12	-	105,26	1,00	1.894.632,10	0,29	0,23
	Yapı ve Kredi Bankası	20.09.2029	TRSYKKB92911	2,72	3	5.000.000,00	100,00000	01.01.2020	-	-	105,51	1,00	5.275.741,35	0,80	0,65
ARA GRUP TOPLAMI						19.800.000,00							20.276.047,98		2,49
VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMET															
	T. KALKINMA VE YATIRIM BANKASI A.Ş.	15.03.2024	TRPTYV232410	4,19	3	5.000.000,00	100,00000	01.01.2020	-	-	113,08	1,00	5.654.116,56	0,85	0,70
ARA GRUP TOPLAMI						5.000.000,00							5.654.116,56		0,70
GRUP TOPLAMI						682.301.603,00							662.930.554,44		81,57

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI EMEKLİLİK YATIRIM 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		Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Deger	(%)	(%)
				Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Deger	Kur			
VADELİ TL MEVDUAT															
	Akbankası	04.02.2021	TRY Mevduat	18,00	-	30.783.014,71	100,00000	25.12.2020	-	-	100,49	1	30.933.674,52	100,00	3,81
GRUP TOPLAMI						30.783.014,71							30.933.674,52		3,81
TPP															
	-	04.01.2021	-	18,05	-	671.325,32	100,00000	31.12.2020	0,00	-	100,20	1	671.325,31	100,00	0,08
GRUP TOPLAMI						671.325,32							671.325,31		0,08
FON PORTFÖY DEĞERİ						724.813.946,12							812.755.342,25		100,00
DÖVİZ BAKİYELERİ															
			TRY			10.184,18	1,00000	31.12.2020			1	1	10.184,18	100,00	0,00
GRUP TOPLAMI						10.184,18							10.184,18		

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI 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		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	812.755.342		100,38
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	10.184		-
a) Kasa	-		-
b) Bankalar	10.184	100,00	-
i) TL Hesaplar	10.184	100,00	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	14.944.948		1,85
a) Takastan Alacaklar T1	9.260.812	61,97	1,14
b) Takastan Alacaklar T2	5.684.135	38,03	0,70
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	18.021.214		(2,23)
a) Takasa Borçlar T1	15.464.618	85,81	(1,91)
b) Takasa Borçlar T2	1.696.000	9,41	(0,21)
c) Yönetim Ücreti	243.443	1,35	(0,03)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	617.153	3,42	(0,08)
i) Denetim Ücreti	17.002	0,09	-
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	8.205	0,05	-
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	-	-	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	-	-	-
vii) Diğer	591.946	3,28	(0,07)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-		
Fon toplam değeri	809.689.260		100%
Fon toplam değeri (TL)	809.689.260		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	36.621.932.437		
Birim pay değeri (TL)	0,022109		