

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KARMA 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.
KARMA 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. Karma 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. Karma 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. KARMA 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. KARMA 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	(%)	(%)
				Oranı	Sayı	Ornat	Sayı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur				
HİSSE SENEDİ																
	T.C.	-	AKBNK	-	-	722.000,30	6,49574	17.11.2020	-	-	6,93	1,00	5.003.462,08	5,55	2,34	
	T.C.	-	ALKIM	-	-	34.000,00	14,85738	07.12.2020	-	-	14,90	1,00	506.600,00	0,56	0,24	
	T.C.	-	ARCLK	-	-	64.000,00	25,58499	18.12.2020	-	-	30,40	1,00	1.945.600,00	2,16	0,91	
	T.C.	-	ASELS	-	-	108.000,00	15,16484	18.12.2020	-	-	18,25	1,00	1.971.000,00	2,19	0,92	
	T.C.	-	BIMAS	-	-	122.000,00	64,83547	25.12.2020	-	-	75,50	1,00	9.211.000,00	10,21	4,31	
	T.C.	-	CCOLA	-	-	26.913,00	54,07678	17.11.2020	-	-	65,80	1,00	1.770.875,40	1,96	0,83	
	T.C.	-	EREGL	-	-	549.000,00	9,29134	28.12.2020	-	-	14,93	1,00	8.196.570,00	9,09	3,84	
	T.C.	-	GARAN	-	-	436.000,00	8,02615	28.12.2020	-	-	10,37	1,00	4.521.320,00	5,01	2,12	
	T.C.	-	ISCTR	-	-	642.000,36	5,53210	13.11.2020	-	-	7,00	1,00	4.494.002,52	4,98	2,10	
	T.C.	-	KAREL	-	-	20.000,00	20,56153	21.12.2020	-	-	23,06	1,00	461.200,00	0,51	0,22	
	T.C.	-	KCHOL	-	-	238.000,00	16,79268	27.11.2020	-	-	21,12	1,00	5.026.560,00	5,57	2,35	
	T.C.	-	KOZAL	-	-	12.000,00	76,64958	18.12.2020	-	-	96,70	1,00	1.160.400,00	1,29	0,54	
	T.C.	-	KRDMD	-	-	395.000,00	3,76709	03.12.2020	-	-	5,78	1,00	2.283.100,00	2,53	1,07	
	T.C.	-	MAVI	-	-	37.000,00	46,73578	18.12.2020	-	-	52,20	1,00	1.931.400,00	2,14	0,90	
	T.C.	-	SAHOL	-	-	257.000,00	10,60277	18.12.2020	-	-	11,46	1,00	2.945.220,00	3,27	1,38	
	T.C.	-	SISE	-	-	675.999,92	5,91444	17.12.2020	-	-	7,31	1,00	4.941.559,42	5,48	2,31	
	T.C.	-	SOKM	-	-	39.000,00	12,69026	28.12.2020	-	-	12,62	1,00	492.180,00	0,55	0,23	
	T.C.	-	TAVHL	-	-	134.000,00	16,57706	22.12.2020	-	-	21,30	1,00	2.854.200,00	3,16	1,34	
	T.C.	-	TCELL	-	-	491.000,79	14,91997	17.12.2020	-	-	16,10	1,00	7.905.112,72	8,76	3,70	
	T.C.	-	TKFEN	-	-	120.000,00	15,47330	26.11.2020	-	-	16,59	1,00	1.990.800,00	2,21	0,93	
	T.C.	-	TOASO	-	-	60.000,00	22,46818	25.12.2020	-	-	33,92	1,00	2.035.200,00	2,26	0,95	
	T.C.	-	TTKOM	-	-	42.000,00	8,07000	17.12.2020	-	-	8,54	1,00	358.680,00	0,40	0,17	
	T.C.	-	TUPRS	-	-	54.000,00	90,07268	17.12.2020	-	-	108,00	1,00	5.832.000,00	6,47	2,73	
	T.C.	-	TURSG	-	-	375.000,00	6,10943	22.12.2020	-	-	6,60	1,00	2.475.000,00	2,74	1,16	
	T.C.	-	VAKBN	-	-	730.000,00	4,72596	28.12.2020	-	-	4,71	1,00	3.438.300,00	3,81	1,61	
	T.C.	-	VESTL	-	-	71.000,00	17,20887	25.11.2020	-	-	21,06	1,00	1.495.260,00	1,66	0,70	
	T.C.	-	YATAS	-	-	138.000,00	8,56510	14.12.2020	-	-	14,45	1,00	1.994.100,00	2,21	0,93	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KARMA 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 (%)
	T.C.	-	YKBNK	-	-	961.000,20	2,313475	16.12.2020	-	-	3,08	1,00	2.959.880,62	3,28	1,39
GRUP TOPLAMI						7.553.914,57							90.200.582,75		42,22
BANKA BONOSU															
	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	2,06	1,04
ARA GRUP TOPLAMI						2.100.000,00							2.211.885,90		1,04
FİNANSMAN BONOSU															
	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	19.02.2021	TRSOPAS22129	6,20	3	1.925.000,00	100,00000	01.01.2020	37,31	-	102,04	1,00	1.964.328,27	1,83	0,92
ARA GRUP TOPLAMI						1.925.000,00							1.964.328,27		0,92
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.	02.03.2022	TRT020322T17	5,50	6	25.000.000,00	102,08353	07.10.2020	5,18	-	99,51	1,00	24.877.704,23	23,12	11,64
	T.C.	04.05.2022	TRT040522T13	4,50	6	14.500.000,00	97,01671	05.11.2020	7,68	-	94,72	1,00	13.734.426,35	12,77	6,43
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	5,25	6	2.000.000,00	92,97500	14.12.2020	1,52	-	95,24	1,00	1.904.830,61	1,77	0,89
	T.C.	14.09.2022	TRT140922T17	4,25	6	9.000.000,00	91,67048	29.09.2020	6,24	-	94,09	1,00	8.468.320,03	7,87	3,96
	T.C.	17.08.2022	TRT170822T15	5,35	6	5.500.000,00	96,00789	05.11.2020	4,19	-	98,59	1,00	5.422.470,85	5,04	2,54
	T.C.MERKEZ BANKASI	20.10.2021	TRT201021T25	6,90	6	16.500.000,00	107,15495	18.02.2020	6,82	-	101,46	1,00	16.740.848,26	15,56	7,84
	T.C.	22.09.2021	TRT220921T18	4,60	6	12.000.000,00	98,11143	06.11.2020	9,13	-	98,27	1,00	11.791.889,59	10,96	5,52
ARA GRUP TOPLAMI						84.500.000,00							82.940.489,92		38,82
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ															
	ARÇELİK A.Ş.	16.07.2021	TRSARCL72112	5,49	3	2.000.000,00	100,00000	01.01.2020	4,56	-	103,03	1,00	2.060.692,62	1,92	0,96
	TÜRKİYE İŞ BANKASI	06.06.2029	TRSTISB62911	4,31	3	4.000.000,00	100,00000	22.01.2020	0,62	-	101,45	1,00	4.057.923,07	3,77	1,90
	T.C.	06.09.2027	TRSVKFB92719	4,15	3	6.500.000,00	100,00000	01.01.2020	-	-	107,46	1,00	6.984.862,17	6,49	3,27
	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2029	TRSYKBK62914	6,36	3	7.000.000,00	100,00000	01.01.2020	0,12	-	105,26	1,00	7.368.013,72	6,85	3,45
ARA GRUP TOPLAMI						19.500.000,00							20.471.491,58		9,58
GRUP TOPLAMI						108.025.000,00							107.588.195,65		50,36

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KARMA 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 (%)
TERS REPO															
	T.C.	04.01.2021	TRT030523T13	17,25	-	2.003.780,82	2,124552	31.12.2020	-	941.375,00	212,86	1,00	2.003.780,82	100,00	0,94
GRUP TOPLAMI						2.003.780,82				941.375,00			2.003.780,82		0,94
VADELİ MEVDUAT															
	Türkiye Garanti Bankası	11.02.2021	TRY Mevduat	18,00	-	5.000.000,00	100,00000	28.12.2020	-	-	100,34	1,00	5.017.078,11	38,20	2,35
	Akbankası	06.01.2021	TRY Mevduat	17,00	-	8.000.000,00	100,00000	04.12.2020	-	-	101,44	1,00	8.115.138,04	61,80	3,80
GRUP TOPLAMI						13.000.000,00							13.132.216,15		6,15
TPP															
	-	04.01.2021	-	18,05	-	130.257,15	100,00000	31.12.2020	-	-	100,20	1,00	130.257,15	100,00	0,06
GRUP TOPLAMI						130.257,15							130.257,15		0,06
TEMİNAT İŞLEMLERİ															
	-	-	Teminat	-	-	587.818,21	1,00000	31.12.2020	-	-	1,00	1,00	587.818,21	100,00	0,28
GRUP TOPLAMI						587.818,21							587.818,21		0,28
FON PORTFOY DEGERİ						131.300.770,75				941.375,00			213.642.850,73		100
DÖVİZ BAKİYELERİ															
	-	-	TRY	-	-	8.913,60	1,00000	31.12.2020	-	-	1,00	1,00	8.913,60	100,00	-
GRUP TOPLAMI						8.913,60							8.913,60		

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KARMA 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	Grup	Toplam
	TL	%	%
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	213.642.851		96,95
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	8.914		-
a) Kasa	-		-
b) Bankalar	8.914	100,00	-
i) TL Hesaplar	8.914	100,00	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	11.308.339	-	5,12
a) Takastan Alacaklar T1	9.063.894	80,39	4,11
b) Takastan Alacaklar T2	2.099.424	18,62	0,95
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	145.022	0,99	0,05
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	4.563.977	-	(2,07)
a) Takasa Borçlar T1	3.366.353	73,76	(1,53)
b) Takasa Borçlar T2	409.964	8,98	(0,19)
c) Yönetim Ücreti	442.721	9,70	(0,20)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	344.939	7,56	(0,16)
i) Denetim Ücreti	6.679	0,15	-
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	6.938	0,15	-
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	6.745	0,15	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	-	-	-
vii) Diğer	324.578	7,11	(0,15)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	220.396.126		100%
Fon toplam değeri (TL)	220.396.126		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	1.593.277.449		
Birim pay değeri (TL)	0,138329		