

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI 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.
BORÇLANMA ARAÇLARI 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. Borçlanma Araçları 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. Borçlanma Araçları 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. BORÇLANMA ARAÇLARI 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. BORÇLANMA ARAÇLARI 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 (%)
HİSSE SENETLERİ															
	T.C.	-	TOASO	-	-	70.000,00	33,85143	31.12.2020	-	-	33,92	1,00	2.374.400,00	100,00	0,92
GRUP TOPLAMI						70.000,00							2.374.400,00		0,92
BANKA BONOSU															
	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	2,08	1,89
ARA GRUP TOPLAMI						5.000.000,00							4.879.698,50		1,89
FİNANSMAN BONOSU															
	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	19.02.2021	TRSOPAS22129	6,20	3	3.700.000,00	100,00000	01.01.2020	37,31	-	102,04	1,00	3.775.592,00	1,61	1,46
ARA GRUP TOPLAMI						3.700.000,00							3.775.592,00		1,46
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.	02.03.2022	TRT020322T17	5,50	6	3.000.000,00	98,17637	02.04.2020	5,18	-	99,51	1,00	2.985.324,51	1,27	1,15
	T.C.	08.03.2023	TRT080323T10	3,55	6	5.000.000,00	89,53550	20.05.2020	6,71	-	89,92	1,00	4.495.962,26	1,92	1,74
	T.C.	08.03.2028	TRT080328T15	6,20	6	19.500.000,00	107,50781	21.08.2020	0,43	-	103,00	1,00	20.084.744,61	8,57	7,76
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	5,30	6	12.000.000,00	93,04168	11.12.2020	1,57	-	97,23	1,00	11.668.162,37	4,98	4,51
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	5,25	6	9.000.000,00	97,72438	01.12.2020	1,52	-	95,24	1,00	8.571.737,76	3,66	3,31
	T.C.	12.03.2025	TRT120325T12	4,00	6	4.000.000,00	90,19808	01.01.2020	4,40	-	86,85	1,00	3.473.972,70	1,48	1,34
	T.C.	13.11.2030	TRT131130T14	5,85	6	4.000.000,00	96,33571	21.12.2020	0,92	-	96,69	1,00	3.867.756,71	1,65	1,49
	T.C.	14.06.2023	TRT140623T19	8,10	6	2.000.000,00	109,44176	02.11.2020	1,03	-	105,42	1,00	2.108.474,99	0,90	0,81
	T.C.	17.08.2022	TRT170822T15	5,35	6	20.000.000,00	95,22115	01.01.2020	4,19	-	98,59	1,00	19.718.075,80	8,41	7,62
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	6,10	6	10.000.000,00	103,68571	25.09.2020	1,65	-	102,61	1,00	10.261.439,30	4,38	3,96
	T.C.	18.10.2023	TRT181023T19	10,05	6	3.000.000,00	130,71740	17.03.2020	-	-	119,34	1,00	3.580.217,63	1,53	1,38
	T.C.MERKEZ BANKASI	20.10.2021	TRT201021T25	6,90	6	20.000.000,00	106,16390	09.06.2020	6,82	-	101,46	1,00	20.291.937,28	8,66	7,84
	T.C.MERKEZ BANKASI	21.04.2021	TRT210421T14	10,45	6	400.000,00	110,62301	30.12.2020	15,49	-	105,88	1,00	423.535,93	0,18	0,16
	T.C.	22.09.2021	TRT220921T18	4,60	6	18.000.000,00	90,89661	23.10.2020	9,13	-	98,27	1,00	17.687.834,39	7,54	6,83

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. BORÇLANMA ARAÇLARI 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 (%)
	T.C.	23.02.2022	TRT230222T13	1,50	6	10.000,00	105,46023	01.01.2020	-	-	250,66	1,00	25.065,88	0,01	0,01
	T.C.	24.02.2027	TRT240227T17	5,50	6	18.000.000,00	98,56009	18.12.2020	1,36	-	97,11	1,00	17.480.342,90	7,46	6,75
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	4,50	6	6.000.000,00	88,85440	13.04.2020	3,43	-	92,71	1,00	5.562.631,24	2,37	2,15
	T.C.	27.09.2023	TRT270923T11	4,40	6	5.000.000,00	90,74066	11.12.2020	5,01	-	91,36	1,00	4.567.858,07	1,95	1,76
ARA GRUP TOPLAMI						158.910.000,00							156.855.074,33		60,61
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ															
	ARÇELİK A.Ş.	12.02.2021	TRSARCL22117	6,17	3	5.120.000,00	100,00000	01.01.2020	37,68	-	102,61	1,00	5.253.442,81	2,24	2,03
	ARÇELİK A.Ş.	16.07.2021	TRSARCL72112	5,49	3	6.000.000,00	100,00000	01.01.2020	4,56	-	103,03	1,00	6.182.077,85	2,64	2,39
	T.C.	29.04.2022	TRSDEVA42219	4,07	3	7.500.000,00	100,00000	04.05.2020	-	-	102,78	1,00	7.708.293,09	3,29	2,98
	DENİZBANK	21.01.2022	TRSDZBK12226	-	0	5.000.000,00	85,91200	08.07.2020	10,36	-	90,19	1,00	4.509.676,50	1,92	1,74
	TÜRKİYE İŞ BANKASI	06.06.2029	TRSTISB62911	4,31	3	8.000.000,00	100,00000	01.01.2020	0,62	-	101,45	1,00	8.115.846,14	3,46	3,14
	T.C.	27.07.2027	TRSTISB72712	4,29	3	3.000.000,00	100,00000	01.01.2020	0,08	-	103,21	1,00	3.096.431,76	1,32	1,20
	TÜRKİYE İŞ BANKASI	13.09.2029	TRSTISB92918	4,01	3	5.000.000,00	100,00000	01.01.2020	0,48	-	100,05	1,00	5.002.550,71	2,13	1,93
	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	05.02.2021	TRSTPRS22114	4,23	3	6.000.000,00	100,00000	01.01.2020	46,58	-	102,67	1,00	6.160.490,38	2,63	2,38
	T.C.	06.09.2027	TRSVKFB92719	4,15	3	7.400.000,00	100,00000	01.01.2020	-	-	107,46	1,00	7.951.996,93	3,39	3,07
	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2029	TRSYKKB62914	6,36	3	8.000.000,00	100,00000	01.01.2020	0,12	-	105,26	1,00	8.420.587,10	3,59	3,25
ARA GRUP TOPLAMI						61.020.000,00							62.401.393,27		24,11
KİRA SERTİFİKALARI															
	Türkiye Finans Katılım Bankası	08.01.2021	TRDTFVK12117	0,76	1	6.500.000,00	99,62521	02.12.2020	20,41	-	100,55	1,00	6.535.918,36	2,79	2,53
ARA GRUP TOPLAMI						6.500.000,00							6.535.918,36		2,53
GRUP TOPLAMI						235.130.000,00							234.447.676,43		90,59

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. BORÇLANMA ARAÇLARI 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 (%)
TERS REPO															
	T.C.	04.01.2021	TRT030523T13	17,25	-	1.001.890,41	2,12454	31.12.2020	-	470.690,00	212,86	1,00	1.001.890,41	9,09	0,39
	T.C.	04.01.2021	TRT070727T13	17,85	-	10.019.561,64	1,64019	31.12.2020	-	6.096.850,00	164,34	1,00	10.019.561,64	90,91	3,87
GRUP TOPLAMI						11.021.452,05				6.567.540,00			11.021.452,05		4,26
VADELİ MEVDUAT															
	Akbankası	04.02.2021	TRY Mevduat	18,25	-	10.135.519,13	100,00000	25.12.2020	-	-	100,50	1,00	10.185.808,62	100,00	3,94
GRUP TOPLAMI						10.135.519,13							10.185.808,62		3,94
TPP															
	-	04.01.2021	-	18,05	-	781.542,90	100,00000	31.12.2020	-	-	100,20	1,00	781.542,90	100,00	0,30
GRUP TOPLAMI						781.542,90							781.542,90		0,30
FON PORTFÖY DEĞERİ						257.138.514,08				6.567.540,00			258.810.880,01		100,00
DÖVİZ BAKİYELERİ															
	-	-	TRY	-	-	14.527,81	1,00000	31.12.2020	-	-	1,00	1,00	14.527,81	100,00	-
	-	-	USD	-	-	0,01	0,00000	29.12.2020	-	-	7,4194	1,00	0,07	-	-
GRUP TOPLAMI						14.527,82							14.527,88		

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. BORÇLANMA ARAÇLARI 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	258.810.880		101,8
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	14.528	-	0,01
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	14.528	100,00	0,01
i) TL Hesaplar	14.528	100,00	0,01
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	0	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	108.775	-	0,03
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	108.775	100,00	0,03
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	2.843.983	-	(1,11)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	2.369.600	83,32	(0,93)
c) Yönetim Ücreti	448.521	15,77	(0,18)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	25.862	0,91	(0,01)
i) Denetim Ücreti	7.846	0,28	-
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	5.435	0,19	-
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	8.168	0,29	-
iv) Noter Masrafı	0	-	-
v) İlan Giderleri	0	-	-
vi) Karşılıklar	0	-	-
vii) Diğer	4.412	0,16	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	256.090.201		100%
Fon toplam değeri (TL)	256.090.201		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	3.473.756.084		
Birim pay değeri (TL)	0,073721		