

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PARA PİYASASI 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.
PARA PİYASASI 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. Para Piyasası 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. Para Piyasası 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. PARA PİYASASI 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. PARA PİYASASI 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 Oram	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
BANKA BONOSU															
	Akbankası	05.01.2021	TRFAKBK12122	-	-	7.000.000,00	99,66170	29.12.2020	19,61	-	99,95	1,00	6.996.566,50	1,98	1,25
	Nurol Bank	13.01.2021	TRFNURL12110	-	-	7.500.000,00	95,63500	16.09.2020	14,67	-	99,66	1,00	7.474.726,50	2,12	1,34
	TÜRKİYE İŞ BANKASI	07.01.2021	TRFTISB12129	-	-	20.000.000,00	96,81800	06.10.2020	13,55	-	99,90	1,00	19.979.122,00	5,66	3,57
	Yapı ve Kredi Bankası	08.01.2021	TRFYKKBK12155	1,52	1	13.000.000,00	100,00000	20.10.2020	-	-	101,65	1,00	13.214.972,68	3,74	2,36
	T.C.	09.04.2021	TRFYKKBK42111	1,40	1	20.000.000,00	100,00000	08.12.2020	0,36	-	101,30	1,00	20.260.317,00	5,74	3,62
ARA GRUP TOPLAMI						67.500.000,00							67.925.704,68		12,14
FİNANSMAN BONOSU															
	T.C.	25.05.2021	TRDTFVK52113	8,06	12	12.990.000,00	100,07829	31.12.2020	16,22	-	101,96	1,00	13.244.971,28	3,75	2,37
	T.C.	26.03.2021	TRFDNFK32129	4,28	1	7.000.000,00	100,00000	11.12.2020	14,66	-	101,17	1,00	7.081.574,57	2,01	1,27
	Dünya Varlık Yönetim A.Ş.	12.11.2021	TRFDVYSK2114	0,50	3	5.000.000,00	100,00000	13.11.2020	-	-	102,94	1,00	5.147.017,20	1,46	0,92
	DENİZ GYO	10.03.2021	TRFDZYO32126	1,25	1	10.000.000,00	100,00000	16.12.2020	1,79	-	100,93	1,00	10.093.362,10	2,86	1,80
	QNB Finansal Kiralama A.Ş.	05.01.2021	TRFFFKR12119	-	-	6.500.000,00	96,19200	15.09.2020	13,49	-	99,97	1,00	6.497.747,10	1,84	1,16
	QNB Finansal Kiralama A.Ş.	16.02.2021	TRFFFKR22126	-	-	6.000.000,00	96,16400	17.11.2020	16,98	-	98,17	1,00	5.890.153,20	1,67	1,05
	Mercedes-Benz Finansman Türk A.Ş.	19.03.2021	TRFMCBF32114	-	-	7.500.000,00	93,71600	22.09.2020	14,23	-	97,34	1,00	7.300.344,75	2,07	1,30
	Orfin Finansman A.Ş.	04.01.2021	TRFORFN12115	-	-	2.000.000,00	95,66100	09.07.2020	-	-	100,00	1,00	2.000.000,00	0,57	0,36
	TEB FİNANSMAN A.Ş.	10.02.2021	TRFTBTF22114	-	-	4.500.000,00	96,12900	11.11.2020	17,16	-	98,41	1,00	4.428.342,90	1,25	0,79
	Vakıf Faktoring A.Ş.	25.01.2021	TRFVFAS12123	-	-	4.000.000,00	96,45600	27.10.2020	15,76	-	99,16	1,00	3.966.463,60	1,12	0,71
	Vakıf Faktoring A.Ş.	01.02.2021	TRFVFAS22114	-	-	12.000.000,00	96,61200	13.11.2020	17,03	-	98,80	1,00	11.856.106,80	3,36	2,12
	T.C.	23.03.2021	TRFVFAS32121	-	-	10.000.000,00	95,68200	23.12.2020	19,60	-	96,25	1,00	9.624.678,00	2,73	1,72
	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	14.01.2021	TRFYAKF12116	-	-	12.000.000,00	96,83800	26.10.2020	15,79	-	99,60	1,00	11.951.900,40	3,39	2,14
	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	05.03.2021	TRFYAKF32130	-	-	8.000.000,00	96,76300	29.12.2020	19,96	-	97,05	1,00	7.764.231,20	2,20	1,39
ARA GRUP TOPLAMI						107.490.000,00							106.846.893,10		19,10

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI 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 Tamm	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 (%)
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C.	06.01.2021	TRT060121T16	1,50	6	4.000.000,00	268,03984	04.12.2020	-	-	272,00	1,00	10.880.115,64	3,08	1,94
	T.C.	14.04.2021	TRT140421T13	-	-	6.000.000,00	95,03218	23.12.2020	15,60	-	96,11	1,00	5.766.393,00	1,63	1,03
	T.C.	17.02.2021	TRT170221T12	5,35	6	66.500.000,00	101,50506	23.12.2020	15,07	-	103,58	1,00	68.882.181,69	19,52	12,31
	T.C.MERKEZ BANKASI	21.04.2021	TRT210421T14	10,45	6	53.000.000,00	105,98302	23.12.2020	15,49	-	105,88	1,00	56.118.510,78	15,90	10,03
	T.C.	26.01.2022	TRT260122T11	0,25	3	11.000.000,00	102,52620	23.12.2020	-	-	103,13	1,00	11.344.084,29	3,21	2,03
ARA GRUP TOPLAMI						140.500.000,00							152.991.285,40		27,34
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ															
	Türk Telekomünikasyon A.Ş.	20.01.2022	TRSTTLK12216	1,75	3	5.000.000,00	100,00000	14.12.2020	0,77	-	100,94	1,00	5.046.807,65	1,43	0,90
ARA GRUP TOPLAMI						5.000.000,00							5.046.807,65		0,9
KİRA SERTİFİKALARI															
	Türkiye Finans Katılım Bankası	08.01.2021	TRDTEVK12117	0,76	1	20.000.000,00	99,62521	02.12.2020	20,41	-	100,55	1,00	20.110.518,02	5,70	3,59
ARA GRUP TOPLAMI						20.000.000,00							20.110.518,02		3,59
GRUP TOPLAMI						340.490.000,00							352.921.208,84		63,08
TERS REPO															
	T.C.	04.01.2021	TRT110226T13	17,90	-	18.035.309,59	0,93469	31.12.2020	-	19.257.795,00	93,65	1,00	18.035.309,59	34,62	3,22
	T.C.	04.01.2021	TRT160425T33	17,95	-	20.039.342,47	0,99062	31.12.2020	-	20.189.355,00	99,26	1,00	20.039.342,47	38,46	3,58
	T.C.	04.01.2021	TRT210623T10	17,90	-	2.003.923,29	0,97486	31.12.2020	-	2.051.585,00	97,68	1,00	2.003.923,29	3,85	0,36
	T.C.	04.01.2021	TRT030523T13	17,87	-	10.019.583,56	2,12442	31.12.2020	-	4.707.175,00	212,86	1,00	10.019.583,56	19,23	1,79
	T.C.	04.01.2021	TRT030523T13	17,25	-	2.003.780,82	2,12455	31.12.2020	-	941.375,00	212,86	1,00	2.003.780,82	3,85	0,36
GRUP TOPLAMI						52.101.939,73				47.147.285,00			52.101.939,73		9,31

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI 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					
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutar	Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	
VADELİ MEVDUAT																
	Türkiye Vakıflar Bankası	05.02.2021	TRY Mevduat	18,50	-	15.013.937,66	100,00000	25.12.2020	-	-	100,50	1,00	15.089.296,50	11,04	2,70	
	Türk Ekonomi Bankası	13.01.2021	TRY Mevduat	16,85	-	30.000.000,00	100,00000	08.12.2020	-	-	101,24	1,00	30.372.290,50	22,23	5,43	
	Türkiye Garanti Bankası	03.02.2021	TRY Mevduat	18,00	-	30.041.412,48	100,00000	25.12.2020	-	-	100,49	1,00	30.188.227,39	22,09	5,40	
	TC Ziraat Bankası	02.02.2021	TRY Mevduat	18,00	-	30.337.610,21	100,00000	28.12.2020	-	-	100,34	1,00	30.441.465,12	22,28	5,44	
	Akbankası	04.02.2021	TRY Mevduat	18,25	-	30.406.557,38	100,00000	25.12.2020	-	-	100,50	1,00	30.557.425,86	22,36	5,46	
GRUP TOPLAMI						135.799.517,73							136.648.705,37		24,42	
TPP																
	-	16.03.2021	-	13,80	-	10.680.547,95	100,00000	17.09.2020	-	-	103,19	1,00	10.318.833,64	57,92	1,84	
	-	16.03.2021	-	18,25	-	1.515.654,00	100,00000	14.12.2020	-	-	101,06	1,00	1.464.323,90	8,22	0,26	
	-	04.01.2021	-	18,00	-	20.039,45	100,00000	31.12.2020	-	-	100,20	1,00	20.039,45	0,11	0,00	
	-	16.03.2021	-	13,85	-	5.341.506,85	100,00000	17.09.2020	-	-	103,21	1,00	5.160.607,94	28,97	0,92	
	-	04.01.2021	-	18,05	-	851.681,37	100,00000	31.12.2020	-	-	100,20	1,00	851.681,37	4,78	0,15	
GRUP TOPLAMI						18.409.429,62							17.815.486,30		3,18	
FON PORTFÖY DEĞERİ						546.800.887,08				47.147.285,00			559.487.340,24		100,00	
DÖVİZ BAKİYELERİ																
			TRY			14.459,04	1,00000	31.12.2020			1,00	1,00	14.459,04	100,00	0,00	
GRUP TOPLAMI						14.459,04							14.459,04		0,00	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI 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	559.487.340	-	100,09
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	14.459	-	0,01
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	14.459	100,00	-
i) TL Hesaplar	14.459	100,00	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C.ALACAKLAR	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	540.972	-	(0,10)
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	491.308	90,82	(0,09)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	49.664	9,18	(0,01)
i) Denetim Ücreti	17.164	3,17	-
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	9.691	1,79	-
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	18.129	3,35	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	-	-	-
vii) Diğer	4.680	0,87	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	558.960.828		100%
Fon toplam değeri (TL)	558.960.828		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	7.768.200.130		
Birim pay değeri (TL)	0,071955		