

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
AGRESİF 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



**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
AGRESİF 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**

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Agresif 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 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. Agresif 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 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. AGRESİF DEĞİŞKEN 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. AGRESİF 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	Repo	Günlük					
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme		Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı		Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	
HİSSE SENETLERİ	T.C.	-	AKBNK	-	-		183.250,00	6,25632	30.12.2020	-	-	6,93	1,00	1.269.922,50	4,70	3,31	
	T.C.	-	ALKIM	-	-		18.500,00	13,74458	29.12.2020	-	-	14,90	1,00	275.650,00	1,02	0,72	
	T.C.	-	ARCLK	-	-		26.000,00	25,39684	30.12.2020	-	-	30,40	1,00	790.400,00	2,93	2,06	
	T.C.	-	ARDYZ	-	-		5.750,00	34,34624	23.12.2020	-	-	48,08	1,00	276.460,00	1,02	0,72	
	T.C.	-	ASELS	-	-		37.250,00	16,94750	29.12.2020	-	-	18,25	1,00	679.812,50	2,52	1,77	
	T.C.	-	BIMAS	-	-		32.500,00	64,59217	30.12.2020	-	-	75,50	1,00	2.453.750,00	9,09	6,39	
	T.C.	-	CCOLA	-	-		8.500,00	60,26906	30.12.2020	-	-	65,80	1,00	559.300,00	2,07	1,46	
	T.C.	-	DOHOL	-	-		174.750,00	2,51859	29.12.2020	-	-	3,07	1,00	536.482,50	1,99	1,40	
	T.C.	-	EREGL	-	-		140.500,00	10,96573	31.12.2020	-	-	14,93	1,00	2.097.665,00	7,77	5,46	
	T.C.	-	FONET	-	-		21.000,00	11,29074	30.12.2020	-	-	13,03	1,00	273.630,00	1,01	0,71	
	T.C.	-	PROTO	-	-		1.000,00	100,24990	23.12.2020	-	-	126,00	1,00	126.000,00	0,47	0,33	
	T.C.	-	GARAN	-	-		170.500,00	8,70377	31.12.2020	-	-	10,37	1,00	1.768.085,00	6,55	4,60	
	T.C.	-	ISCTR	-	-		175.500,00	6,11491	30.12.2020	-	-	7,00	1,00	1.228.500,00	4,55	3,20	
	T.C.	-	KCHOL	-	-		60.000,00	17,79065	30.12.2020	-	-	21,12	1,00	1.267.200,00	4,69	3,30	
	T.C.	-	KOZAL	-	-		4.300,00	76,85748	29.12.2020	-	-	96,70	1,00	415.810,00	1,54	1,08	
	T.C.	-	KRDMMD	-	-		168.000,00	5,14470	31.12.2020	-	-	5,78	1,00	971.040,00	3,60	2,53	
	T.C.	-	SAHOL	-	-		86.500,00	10,56875	30.12.2020	-	-	11,46	1,00	991.290,00	3,67	2,58	
	T.C.	-	SISE	-	-		237.250,01	6,40865	30.12.2020	-	-	7,31	1,00	1.734.297,57	6,42	4,52	
	T.C.	-	SOKM	-	-		21.000,00	12,00586	23.12.2020	-	-	12,62	1,00	265.020,00	0,98	0,69	
	T.C.	-	TAVHL	-	-		32.000,00	18,40537	23.12.2020	-	-	21,30	1,00	681.600,00	2,52	1,77	
	T.C.	-	TCELL	-	-		144.000,00	15,56427	30.12.2020	-	-	16,10	1,00	2.318.400,00	8,59	6,04	
	T.C.	-	TOASO	-	-		20.750,00	24,90782	23.12.2020	-	-	33,92	1,00	703.840,00	2,61	1,83	
	T.C.	-	TUPRS	-	-		11.000,00	94,29896	30.12.2020	-	-	108,00	1,00	1.188.000,00	4,40	3,09	
	T.C.	-	TURSG	-	-		147.000,00	6,19452	30.12.2020	-	-	6,60	1,00	970.200,00	3,59	2,53	
	T.C.	-	VAKBN	-	-		205.000,00	4,78932	30.12.2020	-	-	4,71	1,00	965.550,00	3,58	2,51	
	T.C.	-	VESBE	-	-		6.500,00	32,17035	30.12.2020	-	-	40,88	1,00	265.720,00	0,98	0,69	
	T.C.	-	VESTL	-	-		19.250,00	18,52705	29.12.2020	-	-	21,06	1,00	405.405,00	1,50	1,06	
	T.C.	-	YATAS	-	-		39.500,00	9,63048	30.12.2020	-	-	14,45	1,00	570.775,00	2,11	1,49	
	T.C.	-	YKBNK	-	-		308.250,36	2,73664	30.12.2020	-	-	3,08	1,00	949.411,11	3,52	2,47	
	GRUP TOPLAMI							2.505.300,37							26.999.216,18		70,30

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. AGRESİF 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 İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
BANKA BONOSU	Akbankası	-	TRFAKBK22188	-	-	750.000,00	96,27800	04.12.2020	18,15	-	97,65	1,00	732.387,38	16,41	1,90
	ALTERNATİF BANK	-	TRFALNF32123	-	-	600.000,00	95,90700	01.12.2020	17,83	-	97,38	1,00	584.299,86	13,09	1,51
	Türk Ekonomi Bankası	-	TRFTEBK32115	2,35	3	300.000,00	100,00000	05.06.2020	19,83	-	99,35	1,00	298.055,20	6,68	0,77
	Türk Ekonomi Bankası	-	TRFTEBK32123	2,35	3	300.000,00	100,00000	12.06.2020	9,76	-	100,61	1,00	301.843,47	6,76	0,78
	TÜRKİYE İŞ BANKASI	-	TRFTISB12129	-	-	400.000,00	96,81800	06.10.2020	13,55	-	99,90	1,00	399.582,44	8,95	1,04
	Yapı ve Kredi Bankası	-	TRFYKKB12122	-	-	400.000,00	95,42900	10.07.2020	15,97	-	99,55	1,00	398.217,52	8,92	1,03
	Yapı ve Kredi Bankası	-	TRFYKKB22121	-	-	500.000,00	94,47000	03.07.2020	9,44	-	98,87	1,00	494.349,90	11,08	1,28
ARA GRUP TOPLAMI						3.250.000,00							3.208.735,77		8,31
FİNANSMAN BONOSU	Yapı Kredi Faktoring A.Ş.	-	TRFYAKF32114	-	-	650.000,00	96,00000	04.12.2020	18,00	-	97,36	1,00	632.835,97	14,18	1,64
	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	-	TRSOPAS22129	6,20	3	200.000,00	100,00000	01.01.2020	37,31	-	102,04	1,00	204.086,05	4,57	0,53
ARA GRUP TOPLAMI						850.000,00							836.922,02		2,14
DEVLET TAHVİLİ	T.C.MERKEZ BANKASI	-	TRT210421T14	10,45	6	200.000,00	117,48050	16.09.2020	15,49	-	105,88	1,00	211.767,97	4,75	0,55
ARA GRUP TOPLAMI						200.000,00							211.767,97		0,55
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	ARÇELİK A.Ş.	-	TRSARCL22117	6,17	3	200.000,00	100,00	01.01.2020	37,68	-	102,61	1,00	205.212,61	4,60	0,53
ARA GRUP TOPLAMI						200.000,00							205.212,61		0,53
GRUP TOPLAMI						4.500.000,00							4.462.638,36		11,57
TERS REPO	T.C.	-	TRT030523T13	17,25	-	1.001.890,41	2,12	31.12.2020	-	470.690,00	212,86	1,00	1.001.890,41	33,33	2,61
	T.C.	-	TRT030523T13	17,25	-	2.003.780,82	2,12	31.12.2020	-	941.375,00	212,86	1,00	2.003.780,82	66,67	5,22
GRUP TOPLAMI						3.005.671,23				1.412.065,00			3.005.671,23		7,83
KATILMA BELGESİ	-	-	GLDTR	-	-	13.250,00	33,79	06.11.2020	-	-	39,96	1,00	529.470,00	100,00	1,38
GRUP TOPLAMI						13.250,00							529.470,00		1,38

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. AGRESİF 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 Oram	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oram	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
VADELİ MEVDUAT															
	Türkiye Garanti Bankası	-	TRY Mevduat	18,00	-	1.500.000,00	100,00000	28.12.2020	-	-	100,34	1,00	1.505.123,44	76,59	3,92
	Akbankası	-	TRY Mevduat	17,00	-	455.704,92	100,00000	15.12.2020	-	-	100,93	1,00	459.935,12	23,41	1,20
GRUP TOPLAMI						1.955.704,92							1.965.058,56		5,12
TPP															
	-	-	-	18,05	-	1.001.978,08	100,00000	31.12.2020	-	-	100,20	1,00	1.001.978,08	60,98	2,61
	-	-	-	18,05	-	641.265,97	100,00000	31.12.2020	-	-	100,20	1,00	641.265,97	39,02	1,67
GRUP TOPLAMI						1.643.244,05							1.643.244,05		4,28
FON PORTFÖY DEĞERİ						13.623.170,57				1.412.065,00			38.605.298,39		100,00
DÖVİZ BAKİYELERİ															
			TRY			7.525,86	1,00000	31.12.2020			1,00	1,00	7.525,86	100,00	0,20
GRUP TOPLAMI						7.525,86							7.525,86		0,20

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK
YATIRIM FONU**

31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ

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

	31 Aralık 2020		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	38.605.298		98,73%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B.HAZIR DEĞERLER	7.526		0,02
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	7.526	100,00	0,02
i) TL Hesaplar	7.526	100,00	0,02
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	0,03
C.ALACAKLAR	1.313.845	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	227.523	17,32	0,59
b) Takastan Alacaklar T2	1.059.700	80,66	2,74
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	26.622	2,03	0,07
D.DİĞER VARLIKLAR	-	-	-
E.BORÇLAR	819.386	-	-0,02
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	593.513	72,43	1,52
c) Yönetim Ücreti	72.982	8,91	0,19
d) Ödenecek Vergi	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-
f) Krediler	-	-	-
g) Diğer Borçlar	152.892	18,66	0,39
i) Denetim Ücreti	960	0,12	-
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	562	0,07	-
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	1.011	0,12	-
iv) Noter Masrafı	-	-	-
v) İlan Giderleri	-	-	-
vi) Karşılıklar	-	-	-
vii) Diğer	150.359	18,35	(0,38)
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-	-	-
Fon toplam değeri	39.107.283		100%
Fon toplam değeri (TL)	39.107.283		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	2.397.955.175		
Birim pay değeri (TL)	0,016309		