

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KARMA EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
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 2019 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 2020

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

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FONU TANITICI BİLGİLER.....	1-3
II- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	4

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

3 - İEK 31/12/2019 Tarihli Günlük Raporudur

FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	İhracat Kurumu	İfşa Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Şekli	Nominal Değer/Kontrat Savu	Birim Als Fiyatı	Satın Als Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A.HİSSE SENEDİ																
T.C.			AFFES			117.000,00	23,118908	31.12.2019				23,00	1	2.700.360,00	2,45%	1,11%
T.C.			AKBNK			1.320.000,30	625,829,86	31.12.2019				8,11	1	10.705.202,43	9,73%	4,38%
T.C.			ARCLK			107.500,00	18,259741	31.12.2019				20,84	1	2.240.300,00	2,04%	0,92%
T.C.			ASELS			247.500,00	18,682401	09.12.2019				20,94	1	5.182.650,00	4,71%	2,12%
T.C.			BIMAS			105.000,00	40,294292	09.12.2019				46,66	1	4.899.300,00	4,45%	2,00%
T.C.			ENJSA			500.000,00	6,576145	31.12.2019				7,39	1	3.695.000,00	3,36%	1,51%
T.C.			EREGL			550.000,00	7,540214	31.12.2019				9,04	1	4.972.000,00	4,52%	2,02%
T.C.			GARAN			992.500,00	8,409279	27.12.2019				11,14	1	11.056.450,00	10,05%	4,52%
T.C.			ISCTR			785.000,36	5,85601	23.12.2019				6,41	1	5.031.852,31	4,57%	2,06%
T.C.			KOZAL			43.500,00	62,708863	24.12.2019				74,05	1	3.221.175,00	2,93%	1,32%
T.C.			MGROS			112.500,00	16,936324	17.12.2019				24,22	1	2.724.750,00	2,48%	1,12%
T.C.			OTKAR			17.500,00	119,955939	27.12.2019				150	1	2.782.500,00	2,53%	1,14%
T.C.			PCSIS			51.500,00	60,910722	27.12.2019				86,4	1	4.449.600,00	4,04%	1,82%
T.C.			SAHOL			175.000,00	9,188354	27.12.2019				9,54	1	1.669.500,00	1,52%	0,68%
T.C.			SODA			620.000,00	6,013226	31.12.2019				6,18	1	3.831.600,00	3,48%	1,57%
T.C.			TCELI			352.500,79	12,380647	23.12.2019				13,0	1	4.864.510,90	4,42%	1,99%
T.C.			THYAO			742.500,00	13,3616	23.12.2019				14,46	1	10.736.550,00	9,76%	4,39%
T.C.			TKFEN			142.500,00	20,929276	27.12.2019				19,32	1	2.753.100,00	2,50%	1,13%
T.C.			TRGYO			1.010.000,00	2,315817	27.12.2019				2,75	1	2.777.500,00	2,52%	1,14%
T.C.			TTKOM			665.000,00	5,373113	31.12.2019				7,37	1	4.901.050,00	4,46%	2,01%
T.C.			TUPRS			72.000,00	118,035688	31.12.2019				126,8	1	9.129.600,00	8,30%	3,74%
T.C.			YATAS			480.000,00	5,115362	27.12.2019				7,34	1	3.523.200,00	3,20%	1,44%
T.C.			YKBNK			870.000,20	2,289912	09.12.2019				2,48	1	2.157.600,50	1,96%	0,88%
GRUP TOPLAMI						10.079.001,65								110.005.351,14		45,02%

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

2

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

[illegible]

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2019			31 Aralık 2018		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A.FON PORTFÖY DEĞERİ	244.364.129		100,26%	242.133.662	-	100,24%
B.HAZIR DEĞERLER	5.211		0,00%	2.730	-	0,00%
b) Bankalar	5.211	100,00%	0,00%	2.730	100,00%	0,00%
i) TL Hesaplar	5.211	100,00%	0,00%	2.730	100,00%	0,00%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR	68.922		0,03%	665.387	-	0,28%
a) Takastan Alacaklar T1	283.709	42,64%	0,12%	283.709	0	0
b) Takastan Alacaklar T2	381.679	57,36%	0,16%	381.679	1	0
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	68.922	1	0,0003	-	-	-
D.DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00%	0	-	0,00%
E.BORÇLAR	701.951		-0,29%	1.257.557	-	-0,52%
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0	0	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	446.405	63,59%	-0,18%	441.284	35,09%	-0,18%
d) Ödenecek Vergi	0	0	0	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0	0	-	-	-
f) Krediler	0	0	0	-	-	-
g) Diğer Borçlar	255.546	36,41%	-0,10%	816.272	64,91%	-0,34%
i) Denetim Ücreti	4.502	0,64%	0,00%	6.547	0,52%	0,00%
ii) Ödenecek Saklama Komisyonu	2.597	0,37%	0,00%	5.132	0,41%	0,00%
iii) Ödenecek SPK kayda alma ücreti	14.310	2,04%	-0,01%	8.625	0,69%	0,00%
iv) Noter masrafı	0	0	0	-	-	-
v) İlan giderleri	0	0	0	-	-	-
vi) Karşılıklar	0	0	0	-	-	-
vii) Diğer	234.137	33,36%	-0,10%	795.969	63,29%	-0,33%
M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00%	0	-	0,00%
FON TOPLAM DEĞERİ	243.736.311		100,00%	323.455.251		100,00%
Fon toplam değeri (TL)	243.736.311			241.544.222		
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	2.073.075.315			2.737.793.864		
Birim pay değeri (TL)	0,117572			0,088226		