

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
STANDART EMEKLİLİK
YATIRIM FONU
31 ARALIK 2023 TARİHİ
İTİBARIYLA HAZIRLANAN
FİYAT RAPORUNA İLİŞKİN
BAĞIMSIZ DENETÇİ RAPORU

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 ARALIK 2023 TARİHİ İTİBARIYLA HAZIRLANAN
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ
TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ
MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN
BAĞIMSIZ DENETÇİ RAPORU**

**RSM Turkey Uluslararası
Bağımsız Denetim A.Ş.**

Maslak Office Building,
Sümer Sokak, No 4, Kat 2,
34485, Maslak, İstanbul

T +90 212 370 0700
F +90 212 370 0849

www.rsmtr.com

**NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu
Kurucu Yönetim Kurulu' na**

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete' de yayınlanan " Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu' nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu' nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2023 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmî Gazete' de yayınlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Standart Emeklilik Yatırım Fonu bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

RSM Turkey Uluslararası Bağımsız Denetim A.Ş.
Member of RSM International



Eray Yanbol, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 1 Nisan 2024

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31.12.2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

1. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KİYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.		TRAAKBNK91N6			160.000	36,36	28/12/23			36,52	5.843.200	7,48	1,41	1,55
GARAN	TL	GARANTI BANKASI		TRAGARAN91N1			50.000	101,61	26/12/23			58,35	2.917.500	3,73	0,70	0,77
GARAN	TL	GARANTI BANKASI		TRAGARAN91N1			50.000	56,41	28/12/23			58,35	2.917.500	3,73	0,70	0,77
GWIND	TL	GALATA WIND ENERJİ A.Ş.		TREGWIN00014			0,54	14,43	12/09/23			21,74	12	0,00	0,00	0,00
GWIND	TL	GALATA WIND ENERJİ A.Ş.		TREGWIN00014			180.000	21,69	28/12/23			21,74	3.913.200	5,01	0,94	1,04
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.		TRAKCHOL91Q8			45.000	137,72	28/12/23			141,80	6.381.000	8,16	1,54	1,69
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK		TREKOZA00014			190.000	42,46	28/12/23			42,42	8.059.800	10,31	1,94	2,14
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.		TRASAHOL91Q5			100.000	61,45	28/12/23			60,45	6.045.000	7,73	1,46	1,60
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.		TRASISEW91Q3			94	27,76	16/06/23			45,82	4.285	0,01	0,00	0,00
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.		TRATCELL91M1			340.000	55,27	26/12/23			56,10	19.074.000	24,40	4,59	5,06
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.		TRATCELL91M1			-50.000	55,27	28/12/23			56,10	-2.805.000	-3,59	-0,68	-0,74
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.		TRATHYAO91M5			25.000	224,43	28/12/23			228,60	5.715.000	7,31	1,38	1,52
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.		TRETTLK00013			725.000	24,92	26/12/23			24,36	17.661.000	22,60	4,25	4,69
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.		TRETTLK00013			100.000	23,71	28/12/23			24,36	2.436.000	3,12	0,59	0,65
ISMEN	TL	İŞ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.		TREISMD00011			1	8,79	23/08/23			32,00	24	0,00	0,00	0,00
BORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvili																
TRT170424T17	TL	HAZİNE	17/04/24	TRT170424T17	14,53		923,00	108,13	10/08/23	33,37		101,59	938	0,00	0,00	0,00
TRT170724T14	TL	HAZİNE	17/07/24	TRT170724T14	11,30		10.000.000	100,33	16/06/23	40,59		109,14	10.913.715	4,24	2,63	2,90
TRT041224T12	TL	HAZİNE	04/12/24	TRT041224T12	32,58		193.271	91,37	14/08/23	37,83		81,88	158.241	0,06	0,04	0,04
TRT290125T15	TL	HAZİNE	29/01/25	TRT290125T15	0,00		1.500.000	361,76	10/07/23	-4,25		433,70	6.505.486	2,52	1,57	1,73
TRT160425T17	TL	HAZİNE	16/04/25	TRT160425T17	0,00		1.000.000	636,68	16/06/23	-2,03		734,23	7.342.317	2,85	1,77	1,95
TRT180625T13	TL	HAZİNE	18/06/25	TRT180625T13	0,00		19.500.000	398,24	29/12/23	-1,82		405,40	79.052.915	30,68	19,02	20,99
TRT011025T16	TL	HAZİNE	01/10/25	TRT011025T16	0,00		15.000.454	71,91	07/12/23	39,33		74,40	11.160.479	4,33	2,69	2,96
TRT140126T37	TL	HAZİNE	14/01/26	TRT140126T37	11,61		24.500.000	98,15	16/06/23	43,96		108,46	26.572.009	10,31	6,40	7,05
TRT200526T19	TL	HAZİNE	20/05/26	TRT200526T19	11,38		25.000.000	97,24	16/06/23	48,42		104,10	26.025.216	10,10	6,27	6,91
TRT190826T19	TL	HAZİNE	19/08/26	TRT190826T19	11,61		4.000.000	96,40	21/07/23	47,16		105,59	4.223.609	1,64	1,02	1,12
TRT020926T17	TL	HAZİNE	02/09/26	TRT020926T17	7,70		746,00	130,45	16/06/23	32,00		82,79	618	0,00	0,00	0,00
TRT160627T13	TL	HAZİNE	16/06/27	TRT160627T13	5,92		145.692,00	93,21	21/07/23	49,64		100,72	146.746	0,06	0,03	0,04

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31.12.2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

TRT010328T12	TL	HAZİNE	01/03/28	TRT010328T12	12,17	25.447.691	92,47	16/06/23	49,63	101,06	25.718.385	9,98	6,19	6,83
TRT130928T12	TL	HAZİNE	13/09/28	TRT130928T12	12,57	10.000.000	90,09	19/06/23	21,88	91,85	9.184.697	3,56	2,21	2,44
TRT031029T10	TL	HAZİNE	03/10/29	TRT031029T10	12,83	16.000.000	90,63	16/06/23	20,97	90,95	14.551.543	5,65	3,50	3,86
TRT050630T11	TL	HAZİNE	05/06/30	TRT050630T11	16,40	8.905.955	88,33	19/06/23	44,88	93,26	8.305.257	3,22	2,00	2,20
TRT280432T14	TL	HAZİNE	28/04/32	TRT280432T14	9,85	373	170,15	16/06/23	24,52	97,30	363	0,00	0,00	0,00
TRT040832T18	TL	HAZİNE	04/08/32	TRT040832T18	0,00	1.500.000	155,76	18/07/23	0,00	183,31	2.749.696	1,07	0,66	0,73
Özel Sektör Özel Sektör Tahvil														
TRSEFES12413	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.	18/01/24	TRSEFES12413	73,42	1.940.000	100,00	16/06/23	32,64	133,77	2.595.223	1,01	0,62	0,69
TRSCOLAE2518	TL	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.	01/10/25	TRSCOLAE2518	49,40	3.200.000	100,00	28/09/23	55,94	100,61	3.219.424	1,25	0,78	0,85
TRSOPASE2516	TL	OPET PETROLÇÜLÜK A.Ş.	07/10/25	TRSOPASE2516	47,31	10.000.000	100,00	06/10/23	55,95	111,31	11.130.767	4,32	2,68	2,95
TRSGRAN23013	TL	GARANTİ BANKASI	14/02/30	TRSGRAN23013	12,20	1.400.000	100,00	16/06/23	50,71	106,40	1.489.594	0,58	0,36	0,40
MEVDUAT TC ZIRAAT BANKASI	TL		02/01/24		40,00	19.705.000,00		29/12/23	19.791.378	40,00	19.791.378	33,35	4,76	5,25
TEB A.Ş. TÜRKİYE	TL		02/01/24		28,00	19.705.000		29/12/23	19.765.465	28,00	19.765.465	33,30	4,76	5,25
VAKIFLAR BANKASI T.A.O. Borsa Y.Fonu Türk	TL		02/01/24		40,00	19.705.000		29/12/23	19.791.378	40,00	19.791.378	33,35	4,77	5,25
GLDTR	TL	QNB FİNANS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		TRYFNBK00055		115.000	160,70	28/12/23		175,70	20.205.500	100,00	4,86	5,36
KİRA SERTİFİKALARI Özel Sektör Kira Sertifikaları														
TRDKTLMK2419	TL	Katılım Varlık Kiralama A.Ş.	06/11/24	TRDKTLMK2419	49,40	6.000.000	100,00	11/10/23	54,31	110,36	6.621.625	2,57	1,59	1,76

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31.12.2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

2. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

	<u>TUTAR (TL)</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	415.385.104		110,27
B. HAZIR DEĞERLER	19.904		0,01
a) Kasa	--	0,00	0,00
b) Bankalar	19.904	100,00	0,01
c) Diğer Hazır Değerler	--	0,00	0,00
C.ALACAKLAR	2.852.403		0,76
a)Takastan Alacaklar Toplamı	2.783.760	100,00	0,74
i) T1 Alacakları	2.783.760		0,00
ii) T2 Alacakları	--		0,00
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	--		0,00
b) Diğer Alacaklar	68.643		0,02
i) Diğer Alacaklar	68.643		0,02
ii) Vergi Alacakları	--		0,00
iii) Mevduat Alacakları	--		0,00
iv) Temettu	--		0,00
	<u>TUTAR</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>
D. BORÇLAR	(41.563.783)		-11,03
a) Takasa Borçlar	(40.933.839)	98,48	-10,87
i) T1 Borçları	(40.933.839)		
ii) T2 Borçları	--		
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	--		
iv) İhbarlı FonPay Takas	--		
b) Yönetim Ücreti	(597.795)	1,44	-0,16
c) Ödenecek Vergi	--	0,00	0,00
d) İhtiyatlar	--	0,00	0,00
e) DİĞER_BORÇLAR	(20.847)	0,08	-0,01
i) Diğer Borçlar	(19.408)		-0,01
ii) Denetim Reeskontu	(1.440)		0,00
f) Kayda Alma Ücreti	(11.301)	0,03	0,00
g) Krediler	--	0,00	0,00