

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

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KARMA 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. Karma Emeklilik Yatırım Fonu
Kurucu Yönetim Kurulu' na**

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Karma 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. Karma 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. Karma 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. KARMA EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31.12.2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

1. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALİŞ FİYATI	SATIN ALİŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
AEFES	TL	ANADOLU EFES BİRACILIK VE MALT SANAYİİ A.Ş.		TRAAEFES91A9			30.000	68,48	16/06/23			137,50	4.125.000	1,56	0,89	0,89
AGHOL	TL	AG ANADOLU GRUBU HOLDİNG A.Ş.		TRAYAZIC91Q6			19.000	107,94	16/06/23			200,90	3.817.100	1,45	0,82	0,83
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.		TRAAKBNK91N6			420.000	11,87	16/06/23			36,52	15.338.411	5,81	3,31	3,32
AKSA	TL	AKSA AKRİLİK KİMYA SANAYİİ A.Ş.		TRAAKSAW91E1			23.500	88,27	16/06/23			103,00	2.420.500	0,92	0,52	0,52
AKSEN	TL	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.		TREAKSN00011			45.000	45,60	16/06/23			29,74	1.338.300	0,51	0,29	0,29
ALARK	TL	ALARKO HOLDİNG A.Ş.		TRAALARK91Q0			28.000	75,60	16/06/23			90,60	2.536.800	0,96	0,55	0,55
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.		TRAARCLK91H5			16.500	120,47	16/06/23			128,50	2.120.250	0,80	0,46	0,46
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		TRAASELS91H2			200.000	32,05	29/08/23			44,98	8.996.000	3,41	1,94	1,95
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.		TREBIMM00018			60.000	96,82	16/06/23			300,75	18.045.000	6,83	3,89	3,91
BRYAT	TL	BORUSAN YATIRIM VE PAZARLAMA A.Ş.		TRABRYAT91Q2			950	1.018,69	16/06/23			2.350,00	2.232.500	0,85	0,48	0,48
COLA	TL	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.		TRECOLA00011			10.500	155,27	16/06/23			525,50	5.517.750	2,09	1,19	1,19
CIMSA	TL	ÇİMSA ÇİMENTO SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		TRACIMSA91F9			101.500	18,39	03/10/23			29,34	2.978.010	1,13	0,64	0,64
DOAS	TL	DOĞUŞ OTOMOTİV SERVİS VE TİCARET A.Ş.		TREDOTO00013			13.000	169,60	16/06/23			257,00	3.341.000	1,27	0,72	0,72
DOHOL	TL	DOĞAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.Ş.		TRADOHOL91Q8			120.000	11,23	16/06/23			11,06	1.327.200	0,50	0,29	0,29
EGEEN	TL	EGE ENDÜSTRİ VE TİCARET A.Ş.		TRAEGEEN91H5			150	7.310,32	16/06/23			10.402,50	1.560.375	0,59	0,34	0,34
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.		TREEGYO00017			480.000	8,98	16/06/23			6,88	3.302.400	1,25	0,71	0,71
ENJSA	TL	ENERJISA ENERJİ A.Ş.		TREENSA00014			60.000	33,26	16/06/23			45,54	2.732.400	1,03	0,59	0,59
ENKAI	TL	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.		TREENKA00011			120.000	34,21	16/06/23			34,00	4.080.000	1,55	0,88	0,88
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.		TRAEREGL91G3			240.000	34,41	16/06/23			41,00	9.840.000	3,73	2,12	2,13

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

FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	TRAOTOSN91H6	11.000	331,03	16/06/23	739,50	8.134.500	3,08	1,75	1,76
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI	TRAGARAN91N1	80.000	22,64	16/06/23	58,35	4.668.000	1,77	1,01	1,01
GESAN	TL	GİRİŞİM ELEKTRİK SANAYİ TAAHHÜT VE TİCARET A.Ş.	TREGESN00029	16.000	49,88	16/06/23	66,60	1.065.600	0,40	0,23	0,23
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	TRAGUBRF91E2	10.000	304,16	16/06/23	153,80	1.538.000	0,58	0,33	0,33
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.	TRETHAL00019	75.000	13,31	16/06/23	11,98	898.500	0,34	0,19	0,19
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.	TRAHEKTS91E4	153.000	33,94	16/06/23	20,10	3.075.300	1,16	0,66	0,67
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.S.	TRAISCTR91N2	425.001	11,35	16/06/23	23,36	9.928.019	3,76	2,14	2,15
KAREL	TL	KAREL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	TREKREL00019	2	3,01	29/12/23	11,61	19	0,00	0,00	0,00
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.	TRAKCHOL91Q8	2.500	40,41	29/11/23	141,80	354.500	0,13	0,08	0,08
KONTR	TL	KONTROLMATİK TEKNOLOJİ ENERJİ VE MÜHENDİSLİK A.Ş.	TREKNTR00013	13.500	149,93	16/06/23	217,00	2.929.500	1,11	0,63	0,63
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK	TREKOZA00014	35.000	52,77	16/06/23	42,42	1.484.700	0,56	0,32	0,32
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.	TREKOAL00014	150.150	28,59	16/06/23	19,53	2.932.430	1,11	0,63	0,63
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)	TRAKRDMR91G7	105.000	19,48	16/06/23	23,76	2.494.800	0,94	0,54	0,54
MAVI	TL	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	TREMAVI00037	32.000	34,79	16/06/23	116,50	3.728.000	1,41	0,80	0,81
ODAS	TL	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.	TREODAS00014	200.000	9,88	16/06/23	8,25	1.650.000	0,62	0,36	0,36
OTKAR	TL	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA SANAYİ A.Ş.	TRAOTKAR91H3	10.000	204,73	16/06/23	425,50	4.255.000	1,61	0,92	0,92
PETKM	TL	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.	TRAPETKM91E0	155.000	19,99	16/06/23	18,21	2.822.550	1,07	0,61	0,61
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.	TREPEGS00016	5.500	232,99	16/06/23	649,50	3.572.250	1,35	0,77	0,77
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.	TRASAHOL91Q5	5.000	31,19	29/11/23	60,45	302.250	0,11	0,07	0,07
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.	TRASASAW91E4	166.750	51,67	16/06/23	36,44	6.076.370	2,30	1,31	1,32
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.	TRASISEW91Q3	225.001	21,11	16/06/23	45,82	10.309.542	3,90	2,22	2,23
SMRTG	TL	Smart Güneş Enerjisi Teknolojileri Araştırma Geliştirme Üretim Sanayi ve Ticaret A.Ş.	TRESMAR00026	21.780	38,10	28/07/23	55,25	1.203.345	0,46	0,26	0,26
SOKM	TL	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş.	TRESOKM00022	75.000	17,28	16/06/23	53,95	4.046.250	1,53	0,87	0,88
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.	TRETAVH00018	32.500	53,03	16/06/23	107,50	3.493.750	1,32	0,75	0,76

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

TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.	TRATCELL91M1	205.001	23,62	16/06/23	56,10	11.500.544	4,35	2,48	2,49
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.	TRATHYAO91M5	100.000	55,66	29/11/23	228,60	22.860.000	8,67	4,93	4,95
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	TRETKHO00012	55.000	47,25	16/06/23	36,92	2.030.600	0,77	0,44	0,44
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.	TRATOASO91H3	18.000	88,71	16/06/23	210,00	3.780.000	1,43	0,81	0,82
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	TRETTLK00013	105.000	23,83	16/06/23	24,36	2.557.800	0,97	0,55	0,55
TTRAK	TL	TÜRK TRAKTÖR VE ZİRAAT MAKİNELERİ A.Ş.	TRETTTRK00010	6.563	320,62	16/06/23	712,00	4.672.500	1,77	1,01	1,01
TUPRS	TL	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINELERİ A.S.	TRATUPRS91E8	147.000	40,19	16/06/23	143,00	21.021.000	7,96	4,53	4,55
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	TREVKFB00019	195.000	11,67	16/06/23	12,84	2.503.800	0,95	0,54	0,54
VESBE	TL	VESTEL BEYAZ EŞYA SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	TREVEST00017	1	8,13	16/06/23	16,00	13	0,00	0,00	0,00
VESTL	TL	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	TRAVESTL91H6	30.000	70,39	16/06/23	46,24	1.387.200	0,53	0,30	0,30
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	TRAYKBNK91N6	420.000	7,13	16/06/23	19,54	8.206.804	3,11	1,77	1,78
ISMEN	TL	İŞ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	TREISMD00011	60.000	38,18	03/11/23	32,00	1.920.000	0,73	0,41	0,42
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	TREMGTI00012	15.000	141,81	16/06/23	335,00	5.025.000	1,90	1,08	1,09

BORÇLANMA SENETLERİ

Devlet Tahvili

TRT200324T13	TL	HAZİNE	20/03/24	TRT200324T13	21,85	30.000.000	94,72	16/06/23	41,09	97,74	29.321.706	18,17	6,32	6,35
TRT041224T12	TL	HAZİNE	04/12/24	TRT041224T12	0,00	30.000.355	92,62	08/09/23	37,83	81,88	24.562.910	15,22	5,30	5,32
TRT120325T12	TL	HAZİNE	12/03/25	TRT120325T12	0,00	30.000.000	92,26	02/08/23	39,72	76,73	23.018.619	14,26	4,96	4,98
TRT011025T16	TL	HAZİNE	01/10/25	TRT011025T16	0,00	85.000.000	88,05	09/11/23	39,33	74,40	63.240.800	39,18	13,65	13,69

Özel Sektör Tahvil

TRSVKFB92719	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	06/09/27	TRSVKFB92719	18,79	6.500.000	100,00	16/06/23	30,94	101,67	6.608.721	4,09	1,43	1,43	
TRSTISB62911	TL	T.İŞ BANKASI A.S.	06/06/29	TRSTISB62911	11,91	4.000.000	100,00	16/06/23	48,03	106,87	4.274.905	2,65	0,92	0,93	
TRSYKBK62914	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	20/06/29	TRSYKBK62914	12,41	7.000.000	100,00	16/06/23	43,53	116,46	8.152.373	5,05	1,76	1,76	
TRSGRAN23013	TL	GARANTİ BANKASI	14/02/30	TRSGRAN23013	12,20	2.100.000	100,00	16/06/23	50,70	106,40	2.234.391	1,38	0,48	0,48	
TPP			02/01/24		43,05	874.104	43,05	29/12/23		874.104,49	42,59	874.104	100,00	0,19	0,19

Y.Fonu Türk

IDY-TEB PORTFÖY	TL	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.		TRYOYKB00013	250.000.000	0,04	16/06/23	0,07	17.849.500	73,37	3,85	3,86
-----------------	----	---------------------------	--	--------------	-------------	------	----------	------	------------	-------	------	------

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

İKİNCİ
DEĞİŞKEN FON
REP-RE-PIE
PORTFÖY
YÖNETİMİ A.Ş.
ACE GAMES
GİRİŞİM
SERMAYESİ
YATIRIM FONU
TÜREV

TL

Re-Pie Portföy Yönetimi
A.Ş.

TRYRGG00494

3.000

1.000,00

16/06/23

2.159,16

6.477.502

26,63

1,40

1,40

Kısa

F_XU0300224

TL

TRVXIST03Y44

650,00

8.523,25

29/12/23

8.523,25

55.401.125

0,00

0,00

0,00

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KARMA 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	463.743.185		100,38
B. HAZIR DEĞERLER	6.240		0,00
a) Kasa	--	0,00	0,00
b) Bankalar	6.240	100,00	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	--	0,00	0,00
C.ALACAKLAR	94.117		0,02
a)Takastan Alacaklar Toplamı	--	0,00	0,00
i) T1 Alacakları	--		0,00
ii) T2 Alacakları	--		0,00
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	--		0,00
b) Diğer Alacaklar	94.117		0,02
i) Diğer Alacaklar	94.117		0,02
ii) Vergi Alacakları	--		0,00
iii) Mevduat Alacakları	--		0,00
iv) Temettü	--		0,00
	<u>TUTAR</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>
D. BORÇLAR	(1.868.596)		-0,40
a) Takasa Borçlar	--	0,00	0,00
i) T1 Borçları	--		
ii) T2 Borçları	--		
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	--		
iv) İhbarlı FonPay Takas	(918.096)		
b) Yönetim Ücreti	(906.592)	48,52	-0,20
c) Ödenecek Vergi	--	0,00	0,00
d) İhtiyatlar	--	0,00	0,00
e) DİĞER_BORÇLAR	(30.049)	2,35	-0,01
i) Diğer Borçlar	(26.602)		-0,01
ii) Denetim Reeskontu	(3.447)		0,00
f) Kayda Alma Ücreti	(13.859)	0,74	0,00
g) Krediler	--	0,00	0,00