

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

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. AGRESİF DEĞİŞKEN 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. Agresif Değişken Emeklilik Yatırım Fonu
Kurucu Yönetim Kurulu' na**

NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. Agresif Değişken 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. Agresif Değişken 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. Agresif Değişken 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. AGRESİF DEĞİŞKEN
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	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	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		1.130.829	21,46	10/11/23		36,52	41.297.875	5,06	4,49	4,51
AKCNS	TL	AKÇANSA ÇİMENTO SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		TRAAKCNS91F3		45.003	81,83	26/10/23		142,30	6.403.927	0,78	0,70	0,70
AKFGY	TL	AKFEN GYO A.Ş.		TREAKFG00012		5.400.000	2,42	20/12/23		1,97	10.638.000	1,30	1,16	1,16
AKGRT	TL	AKSİGORTA A.Ş.		TRAAKGRT91O5		2.590.000	5,33	29/09/23		5,25	13.597.500	1,67	1,48	1,49
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		TRAASELS91H2		677.383	43,37	19/12/23		44,98	30.468.687	3,73	3,31	3,33
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.		TREBIMM00018		241.000	143,16	29/09/23		300,75	72.480.750	8,89	7,84	7,92
COLA	TL	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.		TRECOLA00011		56.000	248,79	09/10/23		525,50	29.428.000	3,61	3,20	3,22
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.		TRAEREGL91G3		455.000	42,36	29/09/23		41,00	18.655.000	2,29	2,03	2,04
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI		TRAGARAN91N1		467.809	40,90	10/11/23		58,35	27.296.655	3,35	2,97	2,98
GWIND	TL	GALATA WIND ENERJİ A.Ş.		TREGWIN00014		617.500	17,00	29/09/23		21,74	13.424.459	1,65	1,46	1,47
INDES	TL	İNDEKS BİLGİSAYAR SİSTEMLERİ MÜHENDİSLİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		TREINDX00019		703.125	5,62	04/12/23		5,96	4.190.625	0,51	0,46	0,46
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.		TRAISCTR91N2		1.478.004	16,50	10/11/23		23,36	34.526.176	4,23	3,75	3,77
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.		TRAKCHOL91Q8		257.287	83,44	20/11/23		141,80	36.483.297	4,47	3,97	3,99
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)		TRAKRDMR91G7		602.604	25,49	10/11/23		23,76	14.317.871	1,75	1,56	1,56
MAVI	TL	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		TREMAVI00037		300.500	37,63	29/09/23		116,50	35.008.250	4,29	3,81	3,82
MEDTR	TL	MEDİTERA TIBBİ MALZEME SANAYİ VE TİCARET A.Ş.		TREMDTR00028		146.472	24,42	16/06/23		27,84	4.077.780	0,50	0,44	0,45
MPARK	TL	MPL SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.		TREMLPC00021		140.500	63,39	01/11/23		149,00	20.934.500	2,57	2,28	2,29
OTKAR	TL	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA SANAYİ A.Ş.		TRAOTKAR91H3		68.350	254,85	03/10/23		425,50	29.082.925	3,56	3,16	3,18
OZKGY	TL	ÖZAK GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.		TREOZAK00014		1.527.000	6,28	29/09/23		7,68	11.727.360	1,44	1,28	1,28
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.		TREPEGS00016		19.220	401,59	10/11/23		649,50	12.483.390	1,53	1,36	1,36
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.		TRASAHOL91Q5		759.500	47,79	29/09/23		60,45	45.911.775	5,63	4,99	5,02
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.		TRASISEW91Q3		0	42,00	14/09/23		45,82	0	0,00	0,00	0,00
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.		TRETAVH00018		182.500	95,31	10/10/23		107,50	19.618.750	2,40	2,13	2,14

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. AGRESİF DEĞİŞKEN **EMEKLİLİK YATIRIM FONU 31.12.2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU**

TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.	TRATCELL91M1	1.248.300	47,83	14/12/23		56,10	70.029.630	8,58	7,61	7,65	
THYAO	TL	TURK HAVA YOLLARI A.O.	TRATHYAO91M5	149.543	99,39	10/11/23		228,60	34.185.530	4,19	3,72	3,73	
TRGYO	TL	TORUNLAR GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	TRETRGY00018	667.500	20,17	02/10/23		31,70	21.159.750	2,59	2,30	2,31	
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.	TRETTLK00013	1.205.644	25,42	14/12/23		24,36	29.369.488	3,60	3,19	3,21	
TUPRS	TL	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINELERİ A.S.	TRATUPRS91E8	98.686	57,16	10/11/23		143,00	14.112.098	1,73	1,53	1,54	
TURSG	TL	TÜRKİYE SİGORTA	TRAGUSGR91O3	436.738	37,68	09/11/23		40,56	17.714.093	2,17	1,93	1,94	
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	TRAYKBNK91N6	1.501.281	17,48	10/11/23		19,54	29.335.038	3,60	3,19	3,20	
ISMEN	TL	İŞ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	TREISMD00011	789.200	21,50	03/11/23		32,00	25.254.405	3,10	2,74	2,76	
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	TREMGTI00012	92.500	146,24	29/09/23		335,00	30.987.500	3,80	3,37	3,39	
AVPGY	TL	Avrupakent GYO	TREAVRK00024	300.000	55,08	27/12/23		38,78	11.634.000	1,43	1,27	1,27	
TPP													
TPP			02/01/24	43,00	5.023.562	43,00	29/12/23	5.023.562	42,59	5.023.562	12,72	0,55	0,55
TPP			02/01/24	43,00	10.047.123	43,00	29/12/23	10.047.123	42,59	10.047.123	25,45	1,09	1,10
TPP			02/01/24	43,10	2.009.447	43,10	29/12/23	2.009.447	42,59	2.009.447	5,09	0,22	0,22
TPP			02/01/24	43,05	301.415	43,05	29/12/23	301.415	42,59	301.415	0,76	0,03	0,03
TPP			02/01/24	43,10	4.018.893	43,10	29/12/23	4.018.893	42,59	4.018.893	10,18	0,44	0,44
TPP			02/01/24	43,00	3.014.137	43,00	29/12/23	3.014.137	42,59	3.014.137	7,63	0,33	0,33
TPP			02/01/24	43,00	10.047.123	43,00	29/12/23	10.047.123	42,59	10.047.123	25,45	1,09	1,10
TPP			02/01/24	43,00	3.014.137	43,00	29/12/23	3.014.137	42,59	3.014.137	7,63	0,33	0,33
TPP			02/01/24	43,10	2.009.447	43,10	29/12/23	2.009.447	42,59	2.009.447	5,09	0,22	0,22
DİĞER													
Y.Fonu Türk													
TPL- TEB Portföy Eurobond (Döviz) Borçlanma Araçları Fonu	TL	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	TRYTEBP00054	2.729.651	9,89	16/08/23		11,21	30.610.033	100,00	3,33	3,34	
TÜREV													
Futures													
Uzun													
F_KRDMD0124	TL		TRVXIST040U8	1.700	24,64	26/12/23		24,56	4.175.200	0,00	0,00	0,00	
F_YKBNK0124	TL		TRVXIST041V4	19.700	19,89	26/12/23		20,21	39.813.700	0,00	0,00	0,00	
Kısa													
F_XU0300224	TL		TRVXIST03Y44	639	8.460	26/12/23		8.523,250000	54.463.568	0,00	0,00	0,00	
VIOP Nakit Teminatı				33.949.443					33.949.443	100,00	3,69		

**NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. AGRESİF DEĞİŞKEN
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	919.879.844		100,50
B. HAZIR DEĞERLER	7.704		0,00
a) Kasa	--	0,00	0,00
b) Bankalar	7.704	100,00	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	--	0,00	0,00
C.ALACAKLAR	719.628		0,08
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	719.628		0,08
i) Diğer Alacaklar	719.628		0,08
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	(5.279.195)		-0,58
a) Takasa Borçlar	--	0,00	0,00
i) T1 Borçları	--		
ii) T2 Borçları	--		
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	--		
iv) İhbarlı FonPay Takas	(3.469.355)		
b) Yönetim Ücreti	(1.772.378)	33,57	-0,19
c) Ödenecek Vergi	--	0,00	0,00
d) İhtiyatlar	--	0,00	0,00
e) DİĞER_BORÇLAR	(10.002)	0,71	0,00
i) Diğer Borçlar	(9.892)		0,00
ii) Denetim Reeskontu	(110)		0,00
f) Kayda Alma Ücreti	(27.460)	0,52	0,00
g) Krediler	--	0,00	0,00