

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK
YATIRIM FONU
31 ARALIK 2024 TARİHİ
İTİBARIYLA HAZIRLANAN
FİYAT RAPORUNA 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 EMEKLİLİK A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 ARALIK 2024 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**

NN Hayat Ve Emeklilik A.Ş. Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hesaplanmasına 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 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 2024 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

NN Hayat Ve Emeklilik A.Ş. Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren 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 rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile NN Hayat ve Emeklilik A.Ş. ("Kurucu") bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

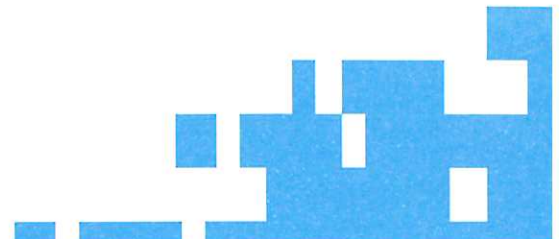
RSM Turkey Uluslararası Bağımsız Denetim A.Ş.
Member of RSM International



Necip Çakmakoglu, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 28 Mart 2025

THE POWER OF BEING UNDERSTOOD
ASSURANCE | TAX | CONSULTING



NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31.12.2024 TARİHLİ FİYAT RAPORU

1. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KİYMET	DÖVİZ CİNSİ	VADE TARİHİ	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
AKBNK	TL		TRAAKBNK91N6			3.300.000,42	40,676091	10/12/24		80100511999901080060		64,850000	214.005.027,24	5,16	4,52	4,79
BIMAS	TL		TREBIMM00018			348.500,00	337,620987	02/12/24		80100511847897320060		528,500000	184.182.250,00	4,44	3,89	4,13
GARAN	TL		TRAGARAN91N1			1.409.500,00	54,943405	02/12/24		80100517500776603140060		124,400000	175.341.800,00	4,23	3,70	3,93
GWIND	TL		TREGWIN00014			2.354.500,44	20,505655	05/12/24		801005175001277201240060		33,820000	79.629.204,88	1,92	1,68	1,78
GWIND	TL		TREGWIN00014			100.000,00	33,983481	31/12/24		801005175001277201240060		33,820000	3.382.000,00	0,08	0,07	0,08
ISCTR	TL		TRAISCTR91N2			14.991.499,68	10,271435	27/11/24		80100517500707767630060		13,540000	202.984.905,67	4,90	4,29	4,55
KCHOL	TL		TRAKCHOL91Q8			1.625.000,00	158,060879	02/12/24		801005110001943174370060		178,600000	290.225.000,00	7,00	6,13	6,50
KOZAA	TL		TREKOZA00014			575.500,00	64,520902	31/12/24		8010051100011541269980060		74,250000	42.730.875,00	1,03	0,90	0,96
KOZAA	TL		TREKOZA00014			1.761.200,00	74,048244	31/12/24		8010051100011541269980060		74,250000	130.769.100,00	3,16	2,76	2,93
KOZAL	TL		TREKOAL00014			514.395,00	23,130814	13/12/24				22,580000	11.615.039,10	0,28	0,25	0,26
KOZAL	TL		TREKOAL00014			4.774.000,00	22,580000	31/12/24				22,580000	107.796.920,00	2,60	2,28	2,41
KRDMD	TL		TRAKRDMR91G7			3.003.000,00	26,005014	02/12/24		801005110001943169410060		27,100000	81.381.300,00	1,96	1,72	1,82
MAVI	TL		TREMAVI00037			905.000,00	23,546699	16/12/24		8010051100011223947320060		87,200000	78.916.000,00	1,90	1,67	1,77
MPARK	TL		TREMLPC00021			463.500,00	121,464174	17/12/24		8010051100011255728940060		382,000000	177.057.000,00	4,27	3,74	3,97
SAHOL	TL		TRASAHOL91Q5			3.185.500,00	67,607996	13/12/24		8010051100011195963930060		96,000000	305.808.000,00	7,38	6,46	6,85
SISE	TL		TRASISEW91Q3			0,02	42,000000	14/09/23		80100515730200720040		41,520000	0,83	0,00	0,00	0,00
TAVHL	TL		TRETAVH00018			618.000,00	153,445578	02/12/24		801005112250763047440060		274,000000	169.332.000,00	4,09	3,57	3,79
TCELL	TL		TRATCELL91M1			3.897.500,00	59,181470	02/12/24		801005112250763046460060		92,800000	361.688.000,00	8,74	7,64	8,10
THYAO	TL		TRATHYAO91M5			851.501,00	215,780293	10/12/24		801005112250906868680060		281,000000	239.271.781,00	5,77	5,05	5,36
TRGYO	TL		TRETRGY00018			3.568.500,00	34,313061	30/12/24		8010051122501200662530060		63,750000	227.491.875,00	5,49	4,80	5,10
TTKOM	TL		TRETTLK00013			4.253.000,00	32,145740	03/12/24		801005112250793387740060		43,480000	184.920.440,00	4,46	3,90	4,14
TURSG	TL		TRAGUSGR91O3			0,11	9,818182	20/08/24		80100511225017732208750050		18,330000	2,02	0,00	0,00	0,00
ULKER	TL		TREULKR00015			733.000,00	138,999210	25/11/24		801005112250655283510060		117,700000	86.274.100,00	2,08	1,82	1,93
YKBNK	TL		TRAYKBNK91N6			10.974.000,00	28,725326	02/12/24		801005112250763044480060		30,620000	336.023.880,00	8,11	7,09	7,53
ISMEN	TL		TREISMD00011			4.273.000,13	29,116334	02/12/24		801005175001278492970060		49,000000	209.377.006,37	5,05	4,42	4,69
ISMEN	TL		TREISMD00011			345.000,00	48,053746	31/12/24		801005175001278492970060		49,000000	16.905.000,00	0,41	0,36	0,38
MGROS	TL		TREMGTI00012			416.000,00	310,303421	02/12/24		801005110001943167990060		547,000000	227.552.000,00	5,49	4,80	5,10
GRUP TOPLAMI						69.240.596,80							4.144.660.507	100,00	87,51	92,85
GRUP TOPLAMI						69.240.596,80							4.144.660.507	100,00	87,51	92,85

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31.12.2024 TARİHLİ FİYAT RAPORU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	VADE TARİHİ	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
T.REPO																
TRT130733T17	TL	02/01/25	TRT130733T17	48,20		100.264.109,59	48,200000	31/12/24	133.639.155,00	795127527436814937	100.264.109,59	48,730000	100.264.109,59	34,85	2,12	2,25
TRT040832T18	TL	02/01/25	TRT040832T18	48,25		7.018.506,85	48,250000	31/12/24	3.568.455,00	795127527436814920	7.018.506,85	48,730000	7.018.506,85	2,44	0,15	0,16
TRT040832T18	TL	02/01/25	TRT040832T18	48,25		3.007.931,51	48,250000	31/12/24	1.529.340,00	795127527436814930	3.007.931,51	48,730000	3.007.931,51	1,05	0,06	0,07
TRT140126T11	TL	02/01/25	TRT140126T11	48,24		12.031.719,45	48,240000	31/12/24	1.348.030,00	795127527436814938	12.031.719,45	48,730000	12.031.719,45	4,18	0,25	0,27
TRT140126T11	TL	02/01/25	TRT140126T11	48,25		10.026.438,36	48,250000	31/12/24	1.123.360,00	795127527436814924	10.026.438,36	48,730000	10.026.438,36	3,48	0,21	0,22
TRT190728T34	TL	02/01/25	TRT190728T34	48,15		50.131.917,81	48,150000	31/12/24	31.554.120,00	795127527436814935	50.131.917,81	48,730000	50.131.917,81	17,42	1,06	1,12
TRT190728T34	TL	02/01/25	TRT190728T34	48,25		88.232.657,53	48,250000	31/12/24	55.535.550,00	795127527436814952	88.232.657,53	48,730000	88.232.657,53	30,66	1,86	1,98
TRT230233T10	TL	02/01/25	TRT230233T10	48,25		5.013.219,18	48,250000	31/12/24	1.406.510,00	795127527436814931	5.013.219,18	48,730000	5.013.219,18	1,74	0,11	0,11
TRT120826T16	TL	02/01/25	TRT120826T16	48,21		12.031.699,73	48,210000	31/12/24	11.066.380,00	795127527436814956	12.031.699,73	48,730000	12.031.699,73	4,18	0,25	0,27
GRUP TOPLAMI						287.758.200,01							287.758.200,01	100,00	6,07	6,45
GRUP TOPLAMI						287.758.200,01							287.758.200,01	100,00	6,07	6,45
TPP																
TPP		02/01/25		48,65		310.826,38	48,650000	31/12/24		399191	310.826,38	48,630000	310.826,38	100,00	0,01	0,01
GRUP TOPLAMI						310.826,38							310.826,38	100,00	0,01	0,01
GRUP TOPLAMI						310.826,38							310.826,38	100,00	0,01	0,01
DİĞER																
Y.Fonu Türk																
YZH TEB																
Portföy BİST																
Banka Endeksi																
Hisse Senedi	TL		TRYTEBP00179			16.666.131,00	9,939319	15/08/24				9,541394	159.018.122,33	100,00	3,36	3,56
Fonu (HİSSE																
SENEDE																
YOĞUN FON)																
GRUP TOPLAMI						16.666.131,00							159.018.122,33	100,00	3,36	3,56
GRUP TOPLAMI						16.666.131,00							159.018.122,33	100,00	3,36	3,56
TÜREV																
Futures																
Uzun																
F_EKGYO0125	TL		TRVXIST04MP3			131.500,00	14,680000	31/12/24		80105125750019258478420060		14,110000	185.546.500,00	0,00	0,00	0,00
Kısa																
F_XU0300225	TL		TRVXIST04JZ8			2.155,00	11.353,000000	31/12/24		8017012605715146320060		11.282,000000	243.127.100,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						133.655,00							428.673.600,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI						133.655,00							428.673.600,00	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																
VIOP Nakit						144.666.784,79							144.666.784,79	100,00	3,05	
Teminatı																
GRUP TOPLAMI						144.666.784,79							144.666.784,79	100,00	3,05	
GRUP TOPLAMI						144.666.784,79							144.666.784,79	100,00	3,05	
FON PORTFÖY DEĞERİ													4.736.414.441		100,00	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31.12.2024 TARİHLİ FİYAT RAPORU

2. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

	<u>TUTAR (TL)</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	4.736.414.441		106,09
B. HAZIR DEĞERLER	29.462		0,00
a) Kasa	0,00	0,00	0,00
b) Bankalar	29.462	100,00	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	0,00	0,00	0,00
C.ALACAKLAR	0,00		0,00
a)Takastan Alacaklar Toplamı	0,00	0,00	0,00
i) T1 Alacakları	0,00		0,00
ii) T2 Alacakları	0,00		0,00
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	0,00		0,00
b) Diğer Alacaklar	0,00		0,00
i) Diğer Alacaklar	0,00		0,00
ii) Vergi Alacakları	0,00		0,00
iii) Mevduat Alacakları	0,00		0,00
iv) Temettu	0,00		0,00
	<u>TUTAR</u>	<u>GRUP %</u>	<u>TOPLAM %</u>
D. BORÇLAR	-271.779.328		-6,09
a) Takasa Borçlar	-258.187.578	95,00	-5,78
i) T1 Borçları	0,00		
ii) T2 Borçları	-258.187.578		
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	0,00		
iv) İhbarlı FonPay Takas	0,00		
b) Yönetim Ücreti	-7.932.795	2,92	-0,18
c) Ödenecek Vergi	0,00	0,00	0,00
d) İhtiyatlar	0,00	0,00	0,00
e) DİĞER_BORÇLAR	-98.443	0,09	0,00
i) Diğer Borçlar	-74.776		0,00
ii) Denetim Reeskontu	-23.667		0,00
f) Kayda Alma Ücreti	-133.940	0,05	0,00
g) Krediler	0,00	0,00	0,00
h) Katılma belgesi borçları	-5.426.572		
<u>FON TOPLAM DEĞERİ</u>	<u>4.464.664.574,74</u>		
Toplam Pay Sayısı	200.000.000.000,000		
Dolaşımdaki Pay	2.319.208.699,175		
Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	197.680.791.300,825		
	% 1,16		
Dolaşımdaki Pay Oranı			
<u>BİRİM PAY DEĞERİ</u>	<u>1,925081</u>		