

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ DEĞİŞKEN 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. İKİNCİ DEĞİŞKEN 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. İkinci Değişken 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. İkinci Değişken 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 Resmi 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.

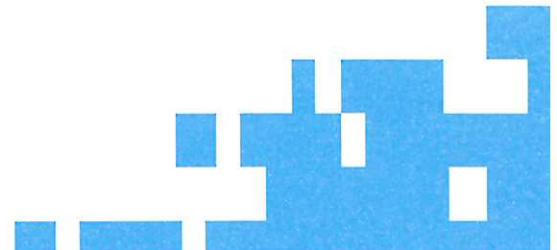
RSM Turkey Uluslararası Bağımsız Denetim A.Ş.
Member of RSM International



Necip Çakmakoglu, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 28 Mart 2025

THE POWER OF BEING UNDERSTOOD
ASSURANCE | TAX | CONSULTING



1. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	VADE TARİHİ	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	BORSA SÖZLEŞME NO	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ														
Hisse Türk														
ALTIN	TL		TRXDRP012213		3.300.000	24,43	22/10/24		80100481238192470060	30,58	100.914.000	9,16	3,96	4,09
GWIND	TL		TREGWIN00014		0	17,00	20/02/24		80100514043560010050	33,82	14	0,00	0,00	0,00
INDES	TL		TREINDX00019		1	5,62	04/01/24		801005117967015630040	7,65	8	0,00	0,00	0,00
ISCTR	TL		TRAISCTR91N2		0	6,73	29/02/24		8010051976190300050	13,54	3	0,00	0,00	0,00
KOZAA	TL		TREKOZA00014		1.315.000	67,29	31/12/24		8010051100011537709760060	74,25	97.638.750	8,82	3,83	3,95
KOZAA	TL		TREKOZA00014		1.150.000	71,16	31/12/24		8010051100011537709760060	74,25	85.387.500	7,72	3,35	3,46
KOZAL	TL		TREKOAL00014		1.620.000	22,03	26/12/24		8010051100011426651430060	22,58	36.579.600	3,31	1,43	1,48
MPARK	TL		TREMLPC00021		30.000	355,87	27/12/24		8010051100011440237270060	382,00	11.460.000	1,04	0,45	0,46
SISE	TL		TRASISEW91Q3		0	42,00	14/09/23		80100515706651500040	41,52	0	0,00	0,00	0,00
YKBNK	TL		TRAYKBNK91N6		0	17,47	09/01/24		801005118289638780040	30,62	11	0,00	0,00	0,00
ISMEN	TL		TREISMD00011		0	21,53	20/02/24		80100514049474290050	49,00	7	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI					7.415.002						331.979.893	30,05	13,02	13,44
Hisse Yabancı														
AAPL	USD		US0378331005		11.108	186,97	05/08/24			252,43	98.925.499	8,94	3,88	4,01
ADBE	USD		US00724F1012		838	527,70	05/08/24			446,60	13.203.615	1,19	0,52	0,53
AMAT	USD		US0382221051		1.549	181,62	05/08/24			164,48	8.988.807	0,81	0,35	0,36
AMD	USD		US0079031078		3.024	151,80	05/08/24			122,83	13.104.836	1,18	0,51	0,53
AMGN	USD		US0311621009		1.003	300,89	05/08/24			260,66	9.223.705	0,83	0,36	0,37
AMZN	USD		US0231351067		7.539	165,20	05/08/24			222,27	59.118.306	5,34	2,32	2,39
AVGO	USD		US11135F1012		8.671	122,79	05/08/24			235,62	72.078.368	6,51	2,82	2,92
CSCO	USD		US17275R1023		7.538	48,75	05/08/24			59,26	15.758.659	1,42	0,62	0,64
GOOG	USD		US02079K1079		4.069	153,90	05/08/24			192,52	27.636.853	2,50	1,08	1,12
GOOGL.US	USD		US02079K3059		4.255	152,49	05/08/24			191,22	28.705.367	2,59	1,13	1,16
HON	USD		US4385161066		1.218	203,12	05/08/24			226,84	9.747.475	0,88	0,38	0,39
INTC.US	USD		US4581401001		7.965	38,28	05/08/24			20,15	5.661.657	0,51	0,22	0,23
INTU	USD		US4612021034		523	606,75	05/08/24			630,53	11.634.269	1,05	0,46	0,47
META	USD		US30303M1027		2.525	426,43	05/08/24			591,76	52.715.256	4,76	2,07	2,14
MSFT	USD		US5949181045		5.384	396,25	05/08/24			425,78	80.877.303	7,31	3,17	3,28
NFLX	USD		US64110L1061		806	552,53	05/08/24			899,06	25.565.600	2,31	1,00	1,04
NVDA	USD		US67066G1040		17.820	77,50	05/08/24			137,26	86.294.543	7,80	3,38	3,50
QCOM	USD		US7475251036		2.088	164,04	05/08/24			154,90	11.411.067	1,03	0,45	0,46
TSLA	USD		US88160R1014		3.497	206,68	05/08/24			420,09	51.828.840	4,68	2,03	2,10
TXN	USD		US8825081040		1.703	176,72	05/08/24			188,57	11.329.525	1,02	0,44	0,46
CMCSA	USD		US20030N1019		7.324	41,46	05/08/24			37,45	9.675.730	0,87	0,38	0,39
COST	USD		US22160K1051		829	727,53	05/08/24			921,21	26.942.904	2,43	1,06	1,09
LIN	USD		IE000S9YS762		900	462,15	07/11/24			418,69	13.294.418	1,20	0,52	0,54
PEP	USD		US7134481081		2.572	172,94	05/08/24			152,36	13.825.080	1,25	0,54	0,56
TMUS	USD		US8725901040		2.192	167,48	05/08/24			220,61	17.060.553	1,54	0,67	0,69
GRUP TOPLAMI					106.940						774.608.232	69,95	30,36	31,37
GRUP TOPLAMI					7.521.942						1.106.588.125	100,00	43,38	44,81
DİĞER														

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. İKİNCİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 ARALIK 2024 TARİHLİ FİYAT RAPORU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	VADE TARİHİ	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	BORSA SÖZLEŞME NO	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
GLDTR	TL		TRYFNBK00055		905.045	184,73	09/12/24		801001037500394275490060	262,00	237.121.790	29,41	9,29	9,60
ZGOLD.F	TL		TRYZIPO00162		561.627	225,33	22/10/24		8010010312250386458700060	330,00	185.336.910	22,98	7,26	7,51
GRUP TOPLAMI					1.466.672						422.458.700	52,39	16,55	17,11
Borsa Y.Fonu Yabancı														
CNDX	USD		IE00B53SZB19		1.505	977,06	08/11/24			1.216,67	64.601.527	8,01	2,53	2,62
NASD	USD		LU1829221024		21.273	71,32	08/11/24			85,98	64.530.123	8,00	2,53	2,61
QQQ	USD		US46090E1038		4.195	422,14	07/11/24			516,59	76.456.430	9,48	3,00	3,10
GRUP TOPLAMI					26.973						205.588.079	25,49	8,06	8,33
Y.Fonu Türk														
TFF-TEB PORTFÖY														
AMERİKA TEKNOLOJİ	TL		TRYTEBP00021		3.908.445	17,91	08/11/24			24,04	93.975.902	11,65	3,68	3,81
YABANCI BYF FON														
SEPETİ FONU														
TUA TEB PORTFÖY	TL		TRYTEBK00030		123.351.657	0,52	20/11/24			0,68	84.411.019	10,47	3,31	3,42
ALTIN FONU														
GRUP TOPLAMI					127.260.102						178.386.921	22,12	6,99	7,23
GRUP TOPLAMI					128.753.747						806.433.700	100,00	31,60	32,67
TÜREV														
Varant														
AGXAA.C	TL		TRCAKYM00056		1.480.000	29,92	20/12/24		801001101290440060	29,94	44.314.160	100,00	1,74	1,79
GRUP TOPLAMI					1.480.000						44.314.160	100,00	1,74	1,79
Futures														
Uzun														
F_USDTRY1224	TL		TRVXIST03XU2		2.000	35,29	31/12/24		8017612601531365730050	35,31	70.624.000	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI					2.000						70.624.000	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI					1.482.000						114.938.160	100,00	1,74	1,79

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. İKİNCİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 ARALIK 2024 TARİHLİ FİYAT RAPORU

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	VADE TARİHİ	ISIN KODU	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALİŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ ISKONTO ORANI (%)	BORSA SÖZLEŞME NO	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
VIOP Nakit Teminatı														
VIOP Nakit Teminatı					314.230.637						314.230.637	100,00	12,32	
GRUP TOPLAMI					314.230.637						314.230.637	100,00	12,32	
GRUP TOPLAMI					314.230.637						314.230.637	100,00	12,32	
VIOP USD Nakit Teminatı														
VIOP USD Nakit Teminatı					247.000						8.714.234	100,00	0,01	
GRUP TOPLAMI					247.000						8.714.234	100,00	0,01	
GRUP TOPLAMI					247.000						8.714.234	100,00	0,01	
DİĞER														
Döviz														
EUR	EUR		EUR		106	34,98	31/12/24			36,74	3.882	0,00	0,00	0,00
USD	USD		USD		409.492	34,02	31/12/24			35,28	14.447.011	0,00	0,00	0,59
GRUP TOPLAMI					409.598						14.450.893	0,00	0,00	0,59
GRUP TOPLAMI					409.598						14.450.893	0,00	0,00	0,59
KİRA SERTİFİKALARI														
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları														
TRD180226T14	AU1	18/02/26	TRD180226T14	0%	79.600	102,58	29/05/24	-0,048271		103,06	245.913.895	90,64	9,63	9,96
TRD180326T13	AU1	18/03/26	TRD180326T13	200%	7.960	100,00	20/03/24	-2,707228		106,42	25.394.920	9,36	0,99	1,03
GRUP TOPLAMI					87.560						271.308.815	100,00	10,62	10,99
GRUP TOPLAMI					87.560						271.308.815	100,00	10,62	10,99
FON PORTFÖY DEĞERİ											2.551.589.671		99,67	

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. İKİNCİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 ARALIK 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	2.551.589.671		103,35
B. HAZIR DEĞERLER	5.797.456		0,23
a) Kasa	0,00	0,00	0,00
b) Bankalar	60.797	1,05	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	5.736.659	98,95	0,23
C.ALACAKLAR	2.826.844		0,11
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	2.826.844		0,11
i) Diğer Alacaklar	2.826.844		0,11
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	-91.294.498		-3,70
a) Takasa Borçlar	-81.837.611	89,64	-3,31
i) T1 Borçları	-24.953.341		
ii) T2 Borçları	-56.884.270		
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	0,00		
iv) İhbarlı FonPay Takas	0,00		
b) Yönetim Ücreti	-4.474.048	4,90	-0,18
c) Ödenecek Vergi	0,00	0,00	0,00
d) İhtiyatlar	0,00	0,00	0,00
e) DİĞER_BORÇLAR	-77.377	0,17	0,00
i) Diğer Borçlar	-65.935		0,00
ii) Denetim Reeskontu	-11.442		0,00
f) Kayda Alma Ücreti	-74.068	0,08	0,00
g) Krediler	0,00	0,00	0,00
h) Katılması belgesi borçları	-4.831.394		

NN HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. İKİNCİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 ARALIK 2024 TARİHLİ FİYAT RAPORU

<u>FON TOPLAM DEĞERİ</u>	<u>2.468.919.473,34</u>
Toplam Pay Sayısı	100.000.000.000,000
Dolaşımdaki Pay	13.013.946.424,341
Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	86.986.053.575,659
Dolaşımdaki Pay Oranı	% 13,01
<u>BİRİM PAY DEĞERİ</u>	<u>0,189713</u>