

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 HESAP DÖNEMİNE AİT
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA
UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") Pay Fiyatının Hazırlanmasına 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 yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına 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 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. İkinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hazırlanmasına 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 yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına 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 Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.



Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 15 Nisan 2020

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük			100	
Menkul	İhracı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2029	TRSYKKBK62914	0.0636	4	900000	100	03.07.2019	0		103.057	1	927513	100.00%	0.43%
Toplam						900,000.00							927,513.00		0.43%
GRUP TOPLAMI						900,000.00							927,513.00		0.43%
EURO TAHVİL	T.C. Hazine Müsteşarlığı	18.05.2020	T180520	0.0513	1	5,790,000.00	108.31836	28.11.2019			105.0105	6.6621	40,506,287.17	21.47%	18.80%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	05.06.2020	T050620	0.035	2	1,400,000.00	104.57445	16.10.2019			102.4785	5.94	8,522,112	4.52%	3.96%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	12.11.2021	T121121	4.35%	1.000	3,562,000.00	107.36605	22.01.2019			106.1765	6.6621	25,196,108.37	13.35%	11.69%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	11.04.2023	T110423	4.13%	1.000	3,200,000.00	109.4587	15.12.2017			109.0040	6.6621	23,238,257.55	12.32%	10.78%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	31.03.2025	XS1843443356	4.63%	1.000	5,150,000.00	100.41391	26.08.2019			109.4830	6.6621	37,563,414.76	19.91%	17.43%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.06.2025	XS1629918415	3.25%	1.000	2,416,000.00	97.503503	23.07.2019			101.7050	6.6621	16,370,064.15	8.68%	7.60%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	16.02.2026	XS1909184753	5.20%	1.000	4,871,000.00	100.57008	19.07.2019			113.0975	6.6621	36,701,370.49	19.45%	17.03%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	09.10.2026	T091026	2.44%	2.000	100,000.00	93.94063	30.09.2019			96.831	5.94	575,176.14	0.30%	0.27%
Toplam						26,489,000.00							188,672,790.69		87.56%
GRUP TOPLAMI						26,489,000.00							188,672,790.69		87.56%
TOPLAM						27,389,000.00							189,600,303.69		87.99%
VIOP NAKİT TEMİNAT						1,749,819.23							1,749,819.23	25.62%	0.81%
Toplam						1,749,819.23							1,749,819.23		0.81%
VIOP SÖZLEŞMESİ														0.00%	0.00%
Uzun Pozisyon			F_EURTRY0220			2,320.00	6.76426	27.12.2019			6.8054	1	0.00	0.00%	0.00%
Ara Toplam													0.00		0.00%
Kısa Pozisyon			F_USDTRY0220			1,771.00	6.022	27.12.2019			6.0467	1	0.00	0.00%	0.00%
Ara Toplam													0.00		0.00%
Toplam													0.00		0.00%
GRUP TOPLAMI						1,749,819.23							0.00		0.00%
TERS REPO - DT		02.01.2020	TRT050624T19	11.25%		9,005,547.95	99.9893	31.12.2019	11.9	9000960	100.0201	1	9,002,773.55	37.33%	4.18%
		02.01.2020	TRT261022T10	11.25%		11,006,780.82	200.4963	31.12.2019	11.9	5486385	200.5581	1	11,003,389.89	45.62%	5.11%
Toplam						20,012,328.77							20,006,163.44		9.28%
BPP		02.01.2020		10.75%	0.000	2,070,218.73	100000	31.12.2019	11.35		100,029.4480	1	2,069,609.28	8.58%	0.96%
Toplam						2,070,218.73							2,069,609.28		0.96%
YATIRIM FONU KATILMA PAYLARI			YLB			7,024,691.00	0.28471	24.10.2019			0.2908	1	2,042,435.93	8.47%	0.95%
Toplam						7,024,691.00							2,042,435.93		0.95%
GRUP TOPLAMI						29,107,238.50					14487345		24,118,208.65		11.19%
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ						56,496,238.50					14487345		215,468,331.58		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU****31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU**

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2019			31 Aralık 2018		
	Tutar	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%	TL	%	%
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	215,468,332	0.00%	100.42%	173,940,487.95	100.00%	100.30%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	215,468,331	0.00%	100.42%	173,940,487.95	100.00%	100.30%
B,HAZIR DEĞERLER	8,276	0.00%	0.00%	12,017.88	100.00%	0.10%
a) Kasa	0	0.00%	0	-	-	-
b) Bankalar	8,276	100.00%	0.00%	12,017.88	100.00%	0.10%
c) Diğer Hazır Değerler	0	0.00%	0	-	-	-
C,ALACAKLAR	111,852	0.00%	0.05%	15,420.33		0.10%
a) Takastan Alacaklar T1	0	0.00%	0	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	0	0.00%	0	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0	0.00%	0	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	0	0.00%	0	15,420.33	100.00%	0.10%
e) Diğer Alacaklar	111,852	10000.00%	0.05	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	0.00%	0	-	-	-
E,BORÇLAR	-1,011,172	0.00%	-0.47%	-555,684.61	-100.00%	-0.32%
a) Takasa Borçlar T1	0	0.00%	0	-0.01	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0.00%	0	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-328,111	-32.45%	-0.15%	-268,659.23	-48.35%	-0.15%
d) Ödenecek Vergi	0	0.00%	0	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0.00%	0	-	-	-
f) Krediler	0	0.00%	0	-	-	-
g) Diğer Borçlar	-683,060	-67.55%	-0.32%	-287,025.37	-51.65%	-0.17%
Fon toplam değeri	214,577,289.33		100.00%	173,412,241.55		100.18%