

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

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

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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. Altın 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. Altın 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. ALTIN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Mevduat				Numaral	Faiz	Numaral	Birimi	Satın	İç	Repo	Günlük						
Konut	İhracı	Yatır	Mevduat	Faiz	Ödeme	Döner	Alın	Alın	İskonto	Teminat	Birimi	Günlük	Kar	Toplam	Grup	Toplam	FTD
Konut	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarifi	Oran	Tutar	Döner	Kar		Döner	(%)	(%)	%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2020	RSYKBK62914	6,36%	4	1.350.000,00	100	03.07.2019	0		103,06	1	1.391.269,5	100%	0,32%	0,0032	
Toplam						1.350.000,00								1.391.269,50		0,32%	0,32%
GRUP TOPLAMI						1.350.000,00								1.391.269,50		0,32%	0,32%
KUPONLU DEVLET TAH.	T.C. Hazine Müsteşarlığı	24.02.2021	TRT240221T13	1,00%	2,000	134.325,00	22682,062	27.02.2019			29.076,58	1	39.057.121,46	50,15%	8,80%	9,06%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.09.2021	TRT170921T15	1,00%	2,000	134.325,00	27279,86	20.09.2019			28.899,69	1	38.819.512,62	49,85%	8,80%	9,01%	
Toplam						268.650,00								77.876.634,08		17,66%	18,07%
GRUP TOPLAMI						268.650,00								77.876.634,08		17,66%	18,07%
TOPLAM						1.618.650,00								79.267.983,58		17,97%	18,39%
KAMU-TL	T.C. Hazine Müst. Varlık Kırılması	18.06.2021	TRD180621T15	1,00%	2,000	124.375,00	25261,523	21.06.2019	0,00%		28.756,27	1	35.765.610,81	47,95%	8,11%	8,30%	
	T.C. Hazine Müst. Varlık Kırılması	17.09.2021	TRD170921T13	1,00%	2,000	134.325,00	27279,86	20.09.2019	0,00%		28.899,69	1	38.819.512,62	52,05%	0,09	0,09	
Toplam						258.700,00								74.585.123,43		16,91%	17,31%
GRUP TOPLAMI						258.700,00								74.585.123,43		16,91%	17,31%
YİOP NAKİT TEMİNAT						7.165.449,70								7.165.449,70	13,81%	1,62%	1,66%
Toplam						7.165.449,70								7.165.449,70		1,62%	1,66%
OTC FORWARD		02.01.2020	USD/TL	0,00%	0,000	1.706.531,00	5,9495	31.12.2019	0,00%		5,95	1	10.146.009,41	0,00%	0,00%	0,00%	
Unvan Pozisyon			F_USDTRY0020			3.700,00	6,04	30.12.2019			6,05	1	0,00	0	0,00%	0,00%	
			F_XAUUSD0020			1.342,00	1528,157995	31.12.2019			1.527,45	5,9507	0,00	0	0,00%	0,00%	
GRUP TOPLAMI						7.165.449,70								0,00		0,00%	0,00%
ALTIN			ALTIN			736,00	188.216,99	26.12.2019			285.937,23	1	210.449.801,28	95,40%	47,72%	48,83%	
			ALTIN			35,00	290151,0545	02.01.2020			289.629,33	1	10.137.026,55	4,60%	2,30%	2,35%	
Ara Toplam			ALTIN			771,00								220.586.827,83	100,00%	50,02%	51,18%
Toplam						771,00								220.586.827,83		50,02%	51,18%
GRUP TOPLAMI						771,00								220.586.827,83		50,02%	51,18%
BYF KATILMA PAYLARI	GMSTR Finans Portföy Günlük Borsa Yatırım Fonu		GMSTRF			100.000,00	20,819978	24.10.2019			22,65		2.265.100,00	3,81%	0,51%	0,53%	
Toplam						100.000,00								2.265.100,00		0,51%	0,53%
TERS REPO - DT		02.01.2020	TRY020823T11	11,25%		500.308,22	194,7344	31.12.2019	11,90%	256760	194,79	1	500.154,09	0,84%	0,11%	0,12%	
		02.01.2020	TRT120325T12	11,25%		5.003.082,19	85,1864	31.12.2019	11,90%	5889480	85,21	1	5.001.540,86	8,42%	1,13%	1,16%	
		02.01.2020	TRT120325T12	11,25%		4.002.465,75	85,1864	31.12.2019	11,90%	4695595	85,21	1	4.001.232,69	6,73%	0,91%	0,93%	
		02.01.2020	TRT120325T12	11,25%		4.502.773,97	85,1865	31.12.2019	11,90%	5282530	85,21	1	4.501.386,77	7,57%	1,02%	1,04%	
Ara Toplam			TRT120325T12			13.508.321,91								13.504.160,32	22,72%	3,06%	3,13%
Toplam						14.008.630,13								14.004.314,41		3,18%	3,25%

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. ALTIN 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					
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Değer	Alın	Alın	Hesap	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	FTD
Kısmet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Değer	Kur	Değer	(%)	(%)	%
BPP		02.01.2020		10,85%	0	100.059,45	100,000,00	31.12.2019	11,46%		100.029,72	1	100.029,72	0%	0,02%	0,0002
Toplam						100.059,45							100.029,72		0,02%	0,02%
VADELİ MEVD-YP	THL	5.02.2020	180	1,00%		75,00	0,00	09.08.2019			285.937,23	75,2976	21.530.389,67	36,23%	4,88%	5,00%
	YKB	5.02.2020	181	1,00%		75,00	0,00	08.08.2019			285.937,23	75,2988	21.530.742,96	36,23%	4,88%	5,00%
Toplam						150,00							43.061.132,83		9,76%	9,99%
GRUP TOPLAMI						14.208.839,50				16.104.355,00			59.439.576,96		13,48%	13,79%
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ						16.086.960,58				16.104.355,00			441.035.880,00			

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. ALTIN 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 TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	441.035.880,00		102,33	224.508.479,95	100,00%	99,87%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	441.036.423,15		102,33	224.508.480,20	100,00%	99,87%
B,HAZIR DEĞERLER	9.326,43		0,00	299.723,28	100,00%	0,13%
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	9.326,43	100,00	0,00	299.723,28	10000,00%	0,13%
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C,ALACAKLAR	515.312,98		0,12	213.888,03	100,00%	0,10%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	515.311,00	100,00	0,12	213.888,03	100,00%	0,00
f) Peşin Ödenen Giderler	-	-	-	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	-10.576.911,53	0,00	-2,45	226.799,61	100,00%	0,10%
a) Takasa Borçlar T1	-10.155.286,93	-96,01	-2,36	0,01	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-365.009,62	-3,45	-0,08	194.683,66	85,84%	0,09%
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) SPK Kayda Alma Ücreti	-	-	-	-	-	-
h) Pay Geri Alış Borçlar	-	-	-	-	-	-
i) Diğer Borçlar	-56.614,98	-0,54	-0,01	32.115,94	14,16%	0,01%
Fon toplam değeri	430.983.608,00		100,00	224.795.291,65		100,20%