

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

30 HAZİRAN 2020 TARİHİ İTİBARIYLA
FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili	20,153,000.00	25,229,630.86	14.94
Diğer - Teminat	5,372,742.09	5,372,742.09	3.18
Euro Tahvil (Kamu) – EUR (*)	500,000.00	4,021,930.92	2.38
Euro Tahvil (Kamu) – USD (*)	2,745,000.00	18,500,557.50	10.96
Euro Tahvil (Özel) – USD (**)	600,000.00	4,164,408.83	2.47
Finansman Bonosu	10,340,000.00	10,184,264.20	6.03
Özel Sektör Kira Sertifikası	2,600,000.00	2,625,368.00	1.55
Özel Sektör Borçlanma Araçları	41,531,250.00	42,681,924.21	25.28
Takasbank Para Piyasası	440,104.88	440,104.88	0.26
Ters Repo	2,000,434.52	2,000,434.52	1.18
Yabancı Yatırım Fonu (ETF) (***)	30,100.00	10,381,088.63	6.15
Yurtiçi Ortaklık Payları	4,544,010.97	43,231,766.32	25.62
Fon Portföy Değeri		168,834,220.96	100.00

(*) Performans sunum raporunda "Devlet Tahvili / Hazine Bonosu" altında raporlanmıştır.

(**) Performans sunum raporunda "Özel Sektör Borçlanma Araçları" altında raporlanmıştır.

(***) Performans sunum raporunda "Paylar" altında raporlanmıştır.

Portföydeki varlıkların dağılımı aşağıdaki gibidir:

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili		25,229,630.86	14.94
TRT020322T17	2,500,000.00	2,657,300.00	1.57
TRT020823T11	500,000.00	1,103,345.00	0.65
TRT060121T16	1,000,000.00	2,579,050.00	1.53
TRT080720T19	150,000.00	156,850.50	0.09
TRT110226T13	4,000,000.00	4,097,360.00	2.43
TRT110827T16	8,500,000.00	8,436,675.00	5.00
TRT120325T12	3,000.00	2,805.36	0.00
TRT140922T17	1,000,000.00	1,009,830.00	0.60
TRT170221T12	500,000.00	525,815.00	0.31
TRT230222T13	1,000,000.00	2,373,780.00	1.41
TRT261022T10	1,000,000.00	2,286,820.00	1.35
Diğer - Teminat		5,372,742.09	3.18
VIOP NAKİT TEMİNAT	5,372,742.09	5,372,742.09	3.18
Euro Tahvil (Kamu) - EUR		4,021,930.92	2.38
XS0993155398	500,000.00	4,021,930.92	2.38
Euro Tahvil (Kamu) - USD		18,500,557.50	10.96
US900123CG37	545,000.00	3,496,018.60	2.07

US900123CL22	300,000.00	2,041,956.13	1.21
US900123CM05	300,000.00	1,701,575.37	1.01
US900123CR91	650,000.00	4,646,575.57	2.75
US900123CT57	300,000.00	2,194,018.88	1.30
US900123CW86	650,000.00	4,420,412.94	2.62
Euro Tahvil (Özel) - USD		4,164,408.83	2.47
T. VAKIFLAR BANKASI	600,000.00	4,164,408.83	2.47
Finansman Bonosu		10,184,264.20	6.03
AKBANK	3,500,000.00	3,351,940.00	1.99
İŞ FAKTORİNG	1,830,000.00	1,795,438.80	1.06
VAKIF FAKTORİNG	710,000.00	699,520.40	0.41
DENİZBANK	1,800,000.00	1,819,890.00	1.08
TÜRK EKONOMİ BANKASI	2,500,000.00	2,517,475.00	1.49
Özel Sektör Kira Sertifikası		2,625,368.00	1.55
Vakıf Varlık Kiralama	1,000,000.00	1,016,360.00	0.60
Yatırım Varlık Kiralama	1,600,000.00	1,609,008.00	0.95
Özel Sektör Borçlanma Araçları		42,681,924.21	25.28
AG Anadolu Grubu Holding	1,500,000.00	1,520,670.00	0.90
AKFEN HOLDİNG	1,000,000.00	1,009,740.00	0.60
ARÇELİK	3,425,000.00	3,535,374.00	2.09
AYGAZ	1,160,000.00	1,145,279.60	0.68
BOLU ÇİMENTO	1,500,000.00	1,534,650.00	0.91
Enerjisa Enerji	1,000,000.00	1,495,640.00	0.89
EREĞLİ DEMİR ÇELİK	4,000,000.00	4,030,160.00	2.39
GLOBAL YATIRIM HOLDİNG	1,500,000.00	1,537,335.00	0.91
HALK BANKASI	300,000.00	297,096.00	0.18
İŞ BANKASI	7,500,000.00	7,581,820.00	4.49
İŞ G.M.Y.O.	180,000.00	184,341.60	0.11
MİGROS	3,860,000.00	3,935,342.20	2.33
Opet Petrolcülük	2,000,000.00	2,020,340.00	1.20
OTOKOÇ OTOMOTİV	4,550,000.00	4,574,718.00	2.71
T. VAKIFLAR BANKASI	1,000,000.00	1,062,840.00	0.63
TÜPRAŞ	3,000,000.00	3,049,620.00	1.81
AKYÜREK PAZARLAMA DAĞITIM VE TİCARET AS	856,250.00	900,269.81	0.53
YAPI VE KREDİ BANKASI	3,200,000.00	3,266,688.00	1.93
Takasbank Para Piyasası		440,104.88	0.26
Ters Repo		2,000,434.52	1.18
Yabancı Yatırım Fonu		10,381,088.63	6.15
HYG US.Y	8,050.00	4,472,740.50	2.65
JNK US.Y	900.00	619,878.95	0.37
SXSEEX.Y	21,150.00	5,288,469.18	3.13
Yurtiçi Ortaklık Payları		43,231,766.32	25.62
AKBANK	400,000.00	2,432,000.00	1.44
AKSİGORTA	80,000.00	544,800.00	0.32

ANADOLU CAM	292,000.00	1,357,800.00	0.80
ANADOLU EFES BİRACILIK	35,000.00	746,200.00	0.44
ARÇELİK	35,000.00	696,500.00	0.42
ASELSAN	30,000.00	974,400.00	0.58
BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR	76,000.00	5,168,000.00	3.06
DOĞAN HOLDİNG	0.43	0.90	0.00
Enerjisa Enerji	150,000.00	1,290,000.00	0.76
ENKA İNŞAAT	0.01	0.07	0.00
EREĞLİ DEMİR ÇELİK	190,000.84	1,630,207.23	0.97
FORD OTOSAN	2,000.00	141,800.00	0.08
GARANTİ BANKASI	560,000.00	4,737,600.00	2.81
HEKTAŞ	65,000.00	926,250.00	0.55
HÜRRİYET GAZETECİLİK	0.75	1.04	0.00
İŞ BANKASI	240,000.57	1,339,203.15	0.79
İŞ FİNANSAL KİRALAMA	1.07	4.45	0.00
İŞ G.M.Y.O.	0.56	1.09	0.00
İŞ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	0.45	2.83	0.00
KARDEMİR	15,000.40	48,751.30	0.03
KOÇ HOLDİNG	80,000.07	1,440,001.31	0.85
KOZA ALTIN İŞLETMELERİ	15,000.67	1,250,305.51	0.74
KOZA ANADOLU METAL	25,000.00	335,000.00	0.20
MİGROS	5,000.00	192,500.00	0.11
ODAŞ ELEKTRİK	0.32	0.79	0.00
PETKİM	270,000.00	1,152,900.00	0.68
SABANCI HOLDİNG	160,000.00	1,478,400.00	0.88
SODA SANAYİİ	50,000.13	306,000.79	0.18
ŞİŞE CAM	35,000.24	194,251.31	0.12
T. VAKIFLAR BANKASI	140,000.30	746,201.62	0.44
T.S.K.B.	0.96	1.23	0.00
TEKFEN HOLDİNG	0.89	15.13	0.00
TOFAŞ OTOMOBİL FAB.	65,000.00	1,722,500.00	1.02
TRAKYA CAM	200,000.99	718,003.54	0.43
TURKCELL	290,000.70	4,767,611.46	2.83
TÜPRAŞ	7,000.00	626,500.00	0.37
TÜRK HAVA YOLLARI	15,000.00	187,800.00	0.11
TÜRK TELEKOM	225,000.00	1,824,750.00	1.08
TÜRK TRAKTÖR	22,000.00	1,732,500.00	1.03
ÜLKER	10,000.00	243,000.00	0.14
YAPI VE KREDİ BANKASI	690,000.64	1,683,601.57	1.00
YATAŞ	70,000.00	596,400.00	0.35
Toplam		168,834,220.96	100.00

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

30 HAZİRAN 2020 TARİHİ İTİBARIYLA
NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU	Tutar	%
Fon portföy değeri	168,834,220.96	100.67
Hazır değerler	189,750.04	0.11
Alacaklar	192,149.99	0.11
Menkul Değer Düşüş Karşılığı	(900,269.81)	(0.54)
Borçlar	(594,916.71)	(0.35)
Net varlık değeri	167,720,934.48	100.00

Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)

Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)