

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATKI 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.
KATKI 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. Katkı 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. Katkı 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. KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal Faiz	Faiz Ödeme	Nominal Deger/	Birim Alış	Satın Alış	İç İskonto	Repo Teminat	Günlük Birim	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
A.PAY	Akbank		AKBNK			500000	6,488105	22.10.2019			8,11		4055000	7,02%	0,85%
	Anadolu Cam		ANACM			250.000,00	2,8505	29.07.2019			4,3600		1.090.000,00	1,89%	0,23%
	Arcelik		ARCLK			100.000,00	18,2853	07.11.2019			20,8400		2.084.000,00	3,61%	0,44%
	Aselsan		ASELS			125.000,00	19,9831	14.11.2019			20,9400		2.617.500,00	4,53%	0,55%
	BİM Birleşik Mağazalar		BIMAS			35.000,00	36,6309	12.07.2019			46,6600		1.633.100,00	2,83%	0,34%
	Coca Cola İçecek		CCOLA			15.000,00	34,2091	07.10.2019			38,7000		580.500,00	1,01%	0,12%
	Doğan Holding		DOHOL			255.000,00	1,7393	19.12.2019			1,8400		469.200,00	0,81%	0,10%
	Emlak Konut GYO		EKGYO			1.250.000,00	1,4290	23.12.2019			1,4600		1.825.000,00	3,16%	0,38%
	Enka İnşaat		ENKAI			50.000,00	5,8000	04.11.2019			6,4200		321.000,00	0,56%	0,07%
	Ereğli Demir ve Çelik		EREGL			300.000,00	7,2011	19.08.2019			9,0400		2.712.000,00	4,70%	0,57%
	Ford Otomotiv		FROTO			2.000,00	50,5192	20.10.2017			70,8500		141.700,00	0,25%	0,03%
	Türkiye Garanti Bankası		GARAN			380.000,00	8,4032	09.10.2019			11,1400		4.233.200,00	7,33%	0,89%
	İş Bankası		ISCTR			500.000,00	5,4168	04.11.2019			6,4100		3.205.000,00	5,55%	0,67%
	Koç Holding		KCHOL			125.000,00	16,2396	19.06.2019			20,3200		2.540.000,00	4,40%	0,53%
	KEREVİTAŞ GIDA		KERVIT			100.000,00	3,0193	16.12.2019			3,2600		326.000,00	0,56%	0,07%
	Kardemir (D)		KRDMD			750.000,00	2,5700	20.12.2019			2,6600		1.995.000,00	3,46%	0,42%
	Migros Ticaret		MGROS			25.000,00	19,5268	25.10.2019			24,2200		605.500,00	1,05%	0,13%
	Otokar		OTKAR			7.500,00	108,0943	02.12.2019			159,0000		1.192.500,00	2,07%	0,25%
	Petkim		PETKM			500.000,00	3,7600	26.12.2019			3,8100		1.905.000,00	3,30%	0,40%
	Pegasus		PGSUS			7.000,00	64,9857	22.08.2019			86,4000		604.800,00	1,05%	0,13%
	Şişe Cam		SISE			500.000,80	5,0892	26.12.2019			5,2700		2.635.004,23	4,56%	0,55%
	Soda Sanayii		SODA			0,33	4,4455	05.12.2017			6,1800		2,04	0,00%	0,00%
	Turkcell		TCCELL			200.000,00	12,2089	25.10.2019			13,8000		2.760.000,00	4,78%	0,58%
	Türk Hava Yolları		THYAO			250.000,00	12,6349	03.12.2019			14,4600		3615000	6,26%	0,76%
	Tekfen Holding		TKFEN			175.000,00	18,906257	27.12.2019			19,32		3.381.000,00	0,0586	0,71%
	Tofaş Otomobil Fabrikaları		TOASO			50.000,00	20,255334	30.05.2019			26,86		1.343.000,00	0,0233	0,28%
	Torunlar GMYO		TRGYO			125.000,00	2,41	02.12.2019			2,75		343.750,00	0,006	0,07%
	Trakya Cam		TRKCM			300.000,00	3,146667	20.12.2019			3,5		1.050.000,00	0,0182	0,22%
	T.S.K.B.		TSKB			0,09	1,116279	18.12.2019			1,21		0,10	0	0,00%
	Türk Telekom		TTKOM			325.000,00	5	11.12.2019			7,37		2.395.250,00	0,0415	0,50%
	Tüpraş		TUPRS			20.000,00	121,656041	05.11.2019			126,8		2.536.000,00	0,0439	0,53%
	Ülker Bisküvi		ULKER			52.500,00	21,418893	24.12.2019			22,36		1.173.900,00	0,0203	0,25%
	Türkiye Vakıflar Bankası		VAKBN			250.000,00	4,950131	19.12.2019			5,51		1.377.500,00	0,0239	0,29%

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI 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	Yade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Abs	Abs	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	FTD
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	%
	Yapı ve Kredi Bankası		YKBANK			400000,056	2,468574	24.12.2019			2,48		992000,14	1,72%	0,21%	0,21%
Toplam						7.924.001,27							57.738.406,51		12,12%	12,06%
GRUP TOPLAMI						7.924.001,27							57.738.406,51		12,12%	12,06%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2029	TRSYKKBKG2914	6,36%	4,000	900.000,00	100,0000	03.07.2019	0,00%		103,0570	1	927.513,00	18,15%	0,19%	0,19%
Toplam						900.000,00							927.513,00		0,19%	0,19%
VDMK	TKYB 2 Varlık Finansman Fonu	15.03.2024	TRPTYV232410	4,19%	4,000	4.000.000,00	100,0000	15.03.2019	0,00%		104,5430	1	4.181.720,00	81,85%	0,88%	0,87%
Toplam						4.000.000,00							4.181.720,00		0,88%	0,87%
GRUP TOPLAMI						4.900.000,00							5.109.233,00		1,07%	1,07%
DEVLET TAHVİLİ	T.C. Hazine Müsteşarlığı	13.05.2020	TRT130520T14	0,00%	0,000	1.000.000,00	88,2758	01.08.2019	10,66%		96,3750	1	963.750,00	0,25%	0,20%	0,20%
Toplam						1.000.000,00							963.750,00		0,20%	0,20%
KUPONLU DEVLET TAH.	T.C. Hazine Müsteşarlığı	05.02.2020	TRT050220T17	3,70%	2,000	1.000.000,00	98,2538	18.09.2019			102,7080	1	1.027.080,00	0,27%	0,22%	0,21%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	02.03.2022	TRT020322T17	5,50%	2,000	100.000,00	79,5602	22.04.2019			102,8970	1	102.897,00	0,03%	0,02%	0,02%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	18.01.2023	TRT180123T10	6,10%	2,000	35.000.000,00	89,6856	06.09.2019			107,6380	1	37.673.300,00	9,78%	7,91%	7,87%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	08.03.2023	TRT080323T10	3,55%	2,000	6.000.000,00	67,3099	28.03.2019			90,5530	1	5.433.180,00	1,41%	1,14%	1,13%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.06.2023	TRT140623T19	8,10%	2,000	6.000.000,00	94,5195	29.03.2019			114,2070	1	6.852.420,00	1,78%	1,44%	1,43%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	27.09.2023	TRT270923T11	4,40%	2,000	13.500.000,00	82,5999	04.12.2019			94,2810	1	12.727.935,00	3,31%	2,67%	2,66%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	20.03.2024	TRT200324T13	5,20%	2,000	15.000.000,00	78,1269	11.12.2019			99,1740	1	14.876.100,00	3,86%	3,12%	3,11%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	24.07.2024	TRT240724T15	4,50%	2,000	46.500.000,00	92,4480	13.12.2019			93,9370	1	43.680.705,00	11,34%	9,17%	9,12%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	12.03.2025	TRT120325T12	4,00%	2,000	200.000,00	71,4302	28.08.2019			87,9450	1	175.890,00	0,05%	0,04%	0,04%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	11.02.2026	TRT110226T13	5,30%	2,000	127.300.000,00	84,6771	05.12.2019			97,9480	1	124.687.804,00	32,38%	26,18%	26,04%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	24.02.2027	TRT240227T17	5,50%	2,000	81.485.078,00	89,0746	25.12.2019			98,9450	1	80.625.410,43	20,94%	16,93%	16,84%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	11.08.2027	TRT110827T16	5,25%	2,000	47.500.000,00	80,2838	01.11.2019			96,7390	1	45951025	11,93%	9,65%	9,60%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	08.03.2028	TRT080328T15	6,20%	2,000	9.700.000,00	81,9402	04.11.2019			105,8070	1	10.263.279,00	2,67%	2,15%	2,14%
Toplam						389.285.078,00							384077025,4		80,63%	80,21%
GRUP TOPLAMI						390.285.078,00							385.040.775,43		80,84%	80,41%
TOPLAM						395.185.078,00							390.150.008,43		81,91%	81,47%
ViOP NAKİT TEMİNAT						0,00							0,00	0	0,00%	0,00%
Toplam						0,00							0,00		0,00%	0,00%
GRUP TOPLAMI						0,00							0,00		0,00%	0,00%
TERS REPO - DT		02.01.2020	TRT120325T12	11,36%		3.001.867,40	85,1859	31.12.2019	0,1203	3521710	85,212398	1	3.000.933,55	0,1055	0,63%	0,63%
		02.01.2020	TRT210421T14	11,36%		5.003.112,33	112,0792	31.12.2019	0,1203	4461130	112,114104	1	5.001.555,92	0,1759	1,05%	1,04%
Toplam						8.004.979,73							8.002.489,47		1,68%	1,67%

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI 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	Degeri	Alın	Alın	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
BPP		02.01.2020		10,55	0	358.206,95	100.000,00	31.12.2019	0,1112		100.028,90	1	358.103,46	1,26%	0,08%
Toplam						358.206,95							358.103,46		0,08%
VADELİ MEVDUAT	YKB	28.01.2020	40	10,45%		20.000.000,00	0,00	19.12.2019			100,37	1	20.073.531,54	70,60%	4,21%
Toplam						20.000.000,00							20.073.531,54		4,21%
GRUP TOPLAMI						28.363.186,68				7.982.840,00			28.434.124,47		5,97%
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ						431.472.265,95				7.982.840,00			476.322.539,41		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KATKI 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 PORTFOY DEGERI	476.322.539	100,00%	99,47%	325.016.473,76	100,00%	100,00%
(MIZANDAN PORTFOY DEGERI	476.322.538	100,00%	99,47%	325.016.467,46	100,00%	100,00%
B,HAZIR DEGERLER	4.175	100,00%	0,00%	3.791,93	100,00%	-
a) Kasa	0	0,00%	0,00%	-	-	-
b) Bankalar	4.175	100,00%	0,00%	3.791,93	100,00%	-
c) Diğer Hazır Değerler	0	0,00%	0,00%	-	-	-
C,ALACAKLAR	2.919.066	0,00%	0,61%	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	2.854.800	9780,00%	0,60%	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	0	0,00%	0,00%	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0	0,00%	0,00%	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	0	0,00%	0,00%	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	64.266	220,00%	0,01%	-	-	-
f) Peşin Odenen Giderler	0	0,00%	0,00%	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	0,00%	0,00%	-	-	-
E,BORÇLAR	-380.824	0,00%	-0,08%	298.208,25	100,00%	0,09%
a) Takasa Borçlar T1	0	0,00%	0,00%	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00%	0,00%	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-126.959	-33,34%	-0,03%	85.096,77	28,54%	0,03%
d) Odenecek Vergi	0	0,00%	0,00%	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0,00%	0,00%	-	-	-
f) Krediler	0	0,00%	0,00%	-	-	-
g) SPK Kayda Alma Ücreti	0	0,00%	0,00%	-	-	-
h) Pay Geri Alış Borçlar	0	0,00%	0,00%	-	-	-
i) Diğer Borçlar	-253.866	-66,66%	-0,05%	213.111,48	71,46%	0,07%
Fon toplam değeri	478.864.956		100,00%	324.722.057,44		100,09%