

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
UNILEVER DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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 YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
UNILEVER DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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 Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Unilever Dengeli Değişken Grup 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 Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Unilever Dengeli Değişken Grup 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 Yaşam 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 YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. UNILEVER DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ															
	AEFES		AEFES			100,00	21,5800	06/12/19			23,0800		2.308,00	0,72%	0,04%
	AKBANK T.A.Ş.		AKBNK			3.711,00	6,3339	08/11/19			8,1100		30.096,21	9,34%	0,50%
	AKGRT		AKGRT			667,00	3,7763	30/09/19			6,0900		4.062,03	1,26%	0,07%
	ALARK		ALARK			500,00	4,8600	27/11/19			5,9500		2.975,00	0,92%	0,05%
	ALKIM		ALKIM			60,00	27,4732	08/11/19			38,3200		2.299,20	0,71%	0,04%
	ANACM		ANACM			560,00	2,7750	30/09/19			4,3600		2.441,60	0,76%	0,04%
	ANSGR		ANSGR			342,00	3,9826	30/09/19			4,4000		1.504,80	0,47%	0,03%
	ARCLK		ARCLK			278,00	18,5879	30/09/19			20,8400		5.793,52	1,80%	0,10%
	ASELS		ASELS			491,00	22,2285	06/12/19			20,9400		10.281,54	3,19%	0,17%
	BIMAS		BIMAS			282,00	32,7345	30/09/19			46,6600		13.158,12	4,08%	0,22%
	ENERJISA ELEKTRİK		ENJSA			802,00	6,6758	30/09/19			7,3900		5.926,78	1,84%	0,10%
	ENKAI		ENKAI			0,93	5,0214	15/08/19			6,4200		6,00	0,00%	0,00%
	EREGL		EREGL			2.038,00	5,4404	08/11/19			9,0400		18.423,52	5,72%	0,31%
	FROTO		FROTO			72,00	52,7665	30/09/19			70,8500		5.101,20	1,58%	0,08%
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.		GARAN			2.869,00	8,3185	11/10/19			11,1400		31.960,66	9,91%	0,53%
	T.İŞ BANKASI A.Ş.		ISCTR			2.198,00	5,3330	31/10/19			6,4100		14.089,18	4,37%	0,23%
	İŞ YATIRIM		ISMEN			754,00	2,8878	30/09/19			4,5000		3.393,00	1,05%	0,06%
	KCHOL		KCHOL			406,00	12,6282	06/12/19			20,3200		8.249,92	2,56%	0,14%
	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.		KOZAL			110,00	48,6575	06/12/19			74,0500		8.145,50	2,53%	0,14%
	KARDEMİR KARABUK DEMİR ÇELİK S.T.A.Ş.		KRDMD			0,56	3,7925	15/08/19			2,6600		1,49	0,00%	0,00%
	MİGROS TİCARET A.Ş.		MGROS			322,00	18,8311	08/11/19			24,2200		7.798,84	2,42%	0,13%
	OTKAR		OTKAR			20,00	107,4615	30/09/19			159,0000		3.180,00	0,99%	0,05%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. UNILEVER DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	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	(%)	(%)
	PETKM		PETKM			1708,8	3,742188	30/09/19			3,81		6510,53	2,02%	0,11%
	PGSUS		PGSUS			112,00	57,4098	13/12/19			86,4000		9.676,80	3,00%	0,16%
	SAHOL		SAHOL			1.138,00	9,0669	24/10/19			9,5400		10.856,52	3,37%	0,18%
	SISE		SISE			1.052,31	4,5022	30/09/19			5,2700		5.545,69	1,72%	0,09%
	SODA		SODA			523,30	6,4531	31/10/19			6,1800		3.234,01	1,00%	0,05%
	TCELL		TCELL			1.435,00	12,0179	08/11/19			13,8000		19.803,00	6,14%	0,33%
	THYAO		THYAO			1.332,00	9,8704	31/10/19			14,4600		19.260,72	5,97%	0,32%
	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.		TKFEN			324,00	19,5256	27/11/19			19,3200		6.259,68	1,94%	0,10%
	TOASO		TOASO			396,00	19,2787	30/09/19			26,8600		10.636,56	3,30%	0,18%
	TRKCM		TRKCM			0,59	1,3875	15/08/19			3,5000		2,07	0,00%	0,00%
	TSKB		TSKB			4.015,00	0,9028	30/09/19			1,2100		4.858,15	1,51%	0,08%
	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.		TTKOM			1.628,00	5,2034	13/12/19			7,3700		11.998,36	3,72%	0,20%
	TUPRS		TUPRS			107,00	112,9736	26/11/19			126,8000		13.567,60	4,21%	0,22%
	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.		VAKBN			1.341,00	5,0705	30/09/19			5,5100		7.388,91	2,29%	0,12%
	YATAS		YATAS			869,00	5,2778	30/09/19			7,3400		6.378,46	1,98%	0,11%
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.		YKBNK			2.095,92	2,3282	30/09/19			2,4800		5.197,88	1,61%	0,09%
Grup Toplamı						34.661,42							322.371,05	100,00%	5,37%
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili	HAZİNE	15/01/20	TRT150120T16			100.000,00	89,9692	26/04/19	10,577469		104,8449		104.844,88	192,00%	174,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	05/02/20	TRT050220T17			600.000,00	98,6349	10/10/19	10,54142		102,708201		616.249,21	11,26	1021,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	13/05/20	TRT130520T14			280.000,00	83,0081	25/12/19	10,665065		96,3747536		269.849,31	4,93	448,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	08/07/20	TRT080720T19			140.000,00	82,3099	02/12/19	10,807581		103,9722		145.561,13	266,00%	242,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	17/02/21	TRT170221T12			170.000,00	78,6931	26/04/19	11,445839		103,4607		175.883,21	321,00%	292,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	21/04/21	TRT210421T14			100.000,00	107,5118	02/07/19	11,474464		115,5434		115.543,37	211,00%	192,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	22/09/21	TRT220921T18			160.000,00	79,0673	26/04/19	11,614829		99,2799		158.847,81	290,00%	264,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	12/01/22	TRT120122T17			100.000,00	84,0615	26/04/19	11,67608		101,1396		101.139,60	185,00%	168,00%
Devlet Tahvili	HAZİNE	02/03/22	TRT020322T17			200.000,00	90,5732	22/07/19	11,709747		102,8972		205.794,44	376,00%	342,00%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. UNILEVER DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
Devlet Tahvili	HAZİNE	17/08/22	TRT170822T15	20,33%		200000	79,3802	26/04/19	11,765559		102,311179		204622,36	3,74%	3,40%
Devlet Tahvili	HAZİNE	14/09/22	TRT140922T17	84,54%		160.000,00	85,2906	21/10/19	11,43702		96,4846		154.375,40	2,82%	2,56%
Devlet Tahvili	HAZİNE	18/01/23	TRT180123T10	21,65%		160.000,00	79,6064	26/04/19	11,659118		107,637516		172.220,03	3,15%	2,86%
Devlet Tahvili	HAZİNE	08/03/23	TRT080323T10	17,05%		150.000,00	73,4000	26/04/19	11,918713		90,5529		135.829,39	2,48%	2,26%
Devlet Tahvili	HAZİNE	14/06/23	TRT140623T19	0,00%		120.000,00	94,7335	21/06/19	11,69625		114,2066		137.047,92	2,50%	2,28%
Devlet Tahvili	HAZİNE	27/09/23	TRT270923T11	12,35%		120.000,00	88,6993	26/04/19	11,807745		94,2808		113.137,00	2,07%	1,88%
Devlet Tahvili	HAZİNE	20/03/24	TRT200324T13	68,10%		50.000,00	70,4660	31/05/19	11,859747		99,1744		49.587,22	0,91%	0,82%
Devlet Tahvili	HAZİNE	24/07/24	TRT240724T15	63,98%		150.000,00	68,9388	31/05/19	12,237719		93,9367		140.905,07	2,57%	2,34%
Devlet Tahvili	HAZİNE	12/03/25	TRT120325T12	16,10%		140.000,00	70,6609	26/04/19	12,137249		87,9446		123.122,43	2,25%	2,04%
Devlet Tahvili	HAZİNE	11/02/26	TRT110226T13	15,30%		200.000,00	82,3510	26/04/19	12,379178		97,9483		195.896,64	3,58%	3,25%
Devlet Tahvili	HAZİNE	24/02/27	TRT240227T17	12,98%		100.000,00	91,9390	26/04/19	12,371381		98,9446		98.944,61	1,81%	1,64%
Devlet Tahvili	HAZİNE	11/08/27	TRT110827T16	70,20%		180.000,00	73,5447	17/06/19	12,328297		96,7388		174.129,86	3,18%	2,89%
Devlet Tahvili	HAZİNE	08/03/28	TRT080328T15	15,67%		80.000,00	85,7857	26/04/19	12,350964		105,8068		84.645,40	1,55%	1,40%
GRUP TOPLAMI						3.660.000,00							3.678.176,29	67,21%	61,05%
Eurobond Türk	HAZİNE	05/02/25	US900123AW05	5,09%		50.000,00	112,9587	20/05/19	0		112,4410		333.949,77	6,10%	5,54%
Eurobond Türk	HAZİNE	09/10/26	US900123CK49	0,00%		100.000,00	94,9977	02/12/19	0		96,8134		575.071,60	10,51%	9,55%
GRUP TOPLAMI						150.000,00								16,61%	15,09%
Finansman Bonosu	YAPI KREDİ YATIRIM	19/02/20	TRFYKYM22012	115,00%		100.000,00	97,2130	20/11/19	12,005027		98,4895		98.489,52	1,80%	1,63%
Finansman Bonosu	AKBANK T.A.Ş.	26/03/20	TRFAKBK32013	2,00%		500.000,00	100,0000	25/12/19	0		100,2050		501.024,94	9,15%	8,18%
GRUP TOPLAMI						600.000,00							599.514,4600	10,95%	9,95%
Özel Sektör Tahvil	ENERJISA ELEKTRİK	26/07/22	TRSENSA72211	0,51%		200.000,00	115,7043	26/04/19	5,07367		143,2273		286.454,67	5,23%	4,76%
GRUP TOPLAMI						200.000,00							286.454,67	5,23%	4,76%
GRUP TOPLAMI						800.000,00							885.969,13	16,18%	14,71%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. UNILEVER DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	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	(%)	(%)
TPP															
TPP		02/01/20		10,70%		200117,26	10,7	31/12/19			10,7800		200.058,18	100,00%	3,32%
GRUP TOPLAMI						200.117,26							200058,18	100,00%	3,32%
GRUP TOPLAMI						200.117,26							200.058,1800	100,00%	3,32%
VIOP Nakit Teminatı															
VIOP Nakit Teminatı						27902,63							27.902,63	100	0,46%
GRUP TOPLAMI						27.902,63							27.902,6300	100	0,46%
GRUP TOPLAMI						27.902,63							27.902,63	100	0,46%
Diğer															
Döviz															
USD	FED					16283,5	5,743151042	31/12/19			5,94		96.723,99	0,00%	0,00%
GRUP TOPLAMI						16.283,50							96723,99	0,00%	0,00%
GRUP TOPLAMI						16.283,50							96723,99	0,00%	0,00%
FON PORTFÖY DEĞERİ													6.023.498,65		

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. UNILEVER DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	6.023.499	100,00%	98,44%	5.385.928	100,00%	99,32%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	6.023.499	100,00%	98,44%	5.385.928	100,00%	99,32%
B,HAZIR DEĞERLER	102.041	100,00%	1,67%	45.628	100,00%	84,00%
a) Kasa	-	-	0,00%	-	-	-
b) Bankalar	5.317	5,21%	0,09%	45.628	100,00%	84,00%
c) Diğer Hızır Değerler	96.724	94,79%	1,58%	-	-	-
C,ALACAKLAR	-	-	-	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
f) Peşin Ödenen Giderler	-	-	-	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(6.279)		-0,10%	(8.649)	100,00%	0,16%
a) Takasa Borçlar T1				-	-	-
b) Takasa Borçlar T2				-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(3.751)	59,73%	-0,06%	(3.461)	40,01%	0,06%
d) Ödenecek Vergi				-	-	-
e) İhtiyatlar				-	-	-
f) Krediler				-	-	-
g) SPK Kayda Alma Ücreti	(184)	2,92%	0,00%	-	-	-
h) Pay Geri Alış Borçlar				-	-	-
ı) Diğer Borçlar	(2.345)	40,27%	-0,04%	(5.189)	59,99%	0,10%
Fon toplam değeri	6.119.258		100,00%	5.422.907		100,00%