

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
STANDART 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.
STANDART 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. Standart 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. Standart 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.
STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
HİSSE SENETLERİ	AEFES		AEFES			5571	19,852131	13/12/19			23,08		128.578,68	0,91	0,12
HİSSE SENETLERİ	AKBANK T.A.Ş.		AKBNK			144.150,00	6,60	31/12/19			8,11		1.169.056,50	8,28	1,1
HİSSE SENETLERİ	AKSA		AKSA			10.035,00	8,65	17/12/19			13,7		137.479,50	0,97	0,13
HİSSE SENETLERİ	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.		AKSEN			30.000,00	2,73	18/12/19			3,8		114.000,00	0,81	0,11
HİSSE SENETLERİ	ALARK		ALARK			20.000,00	6,05	31/12/19			5,95		119.000,00	0,84	0,11
HİSSE SENETLERİ	ANACM		ANACM			15.000,67	2,94	30/12/19			4,36		65.402,93	0,46	0,06
HİSSE SENETLERİ	ARCLK		ARCLK			12.000,00	17,01	17/12/19			20,84		250.080,00	1,77	0,24
HİSSE SENETLERİ	ASELS		ASELS			12.875,00	19,10	13/12/19			20,94		269.602,50	1,91	0,25
HİSSE SENETLERİ	ASELS		ASELS			4.000,00	20,26	30/12/19			20,94		83.760,00	0,59	0,08
HİSSE SENETLERİ	BİMAS		BİMAS			16.616,00	42,18	13/12/19			46,66		775.302,56	5,49	0,73
HİSSE SENETLERİ	BİMAS		BİMAS			-2.000,00	42,18	31/12/19			46,66		(93.320,00)	-0,66	-0,09
HİSSE SENETLERİ	CCOLA		CCOLA			4.421,00	33,70	13/12/19			38,7		171.092,70	1,21	0,16
HİSSE SENETLERİ	ENERJİSA ELEKTRİK		ENJSA			16.674,00	5,87	13/12/19			7,39		123.220,86	0,87	0,12
HİSSE SENETLERİ	ENKAI		ENKAI			39.803,33	5,26	13/12/19			6,42		255.537,37	1,81	0,24
HİSSE SENETLERİ	ENKAI		ENKAI			-19.803,00	5,26	31/12/19			6,42		(127.135,26)	-0,9	-0,12
HİSSE SENETLERİ	EREGL		EREGL			95.000,00	7,30	17/12/19			9,04		858.800,00	6,09	0,81
HİSSE SENETLERİ	FROTO		FROTO			3.000,00	59,30	17/12/19			70,85		212.550,00	1,51	0,2
HİSSE SENETLERİ	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.		GARAN			115.000,00	8,42	18/12/19			11,14		1.281.100,00	9,13	1,2
HİSSE SENETLERİ	T.İŞ BANKASI A.Ş.		ISCTR			90.900,00	5,41	13/12/19			6,41		582.669,00	4,13	0,55
HİSSE SENETLERİ	ISGYO		ISGYO			0,84	1,43	26/04/19			1,76		1,48	0	0
HİSSE SENETLERİ	KCHOL		KCHOL			20.000,00	16,18	18/12/19			20,32		406.400,00	2,88	0,38
HİSSE SENETLERİ	KORDS		KORDS			5.000,00	11,53	17/12/19			13,08		65.400,00	0,46	0,06
HİSSE SENETLERİ	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.		KOZAL			3.998,00	55,62	13/12/19			74,05		296.051,90	2,1	0,28
HİSSE SENETLERİ	KARDEMİR KARABUK DEMİR ÇELİK S.T.A.Ş.		KRDMD			40.000,14	2,65	17/12/19			2,66		106.400,36	0,75	0,1
HİSSE SENETLERİ	MAVİ JEANS		MAVİ			500,00	38,44	30/12/19			57,9		28.950,00	0,21	0,03
HİSSE SENETLERİ	MİGROS TİCARET A.Ş.		MGROS			5.434,00	16,40	13/12/19			24,22		131.611,48	0,93	0,12
HİSSE SENETLERİ	MİGROS TİCARET A.Ş.		MGROS			5.000,00	24,46	30/12/19			24,22		121.100,00	0,86	0,11
HİSSE SENETLERİ	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC. A.Ş.		ODAS			100.000,40	1,57	18/12/19			2,1		210.000,83	1,49	0,2

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
STANDART 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	(%)	(%)	
HİSSE SENETLERİ	PETKM		PETKM			90448	3,928547	13/11/19			3,81		344.606,88	2,44	0,32	
HİSSE SENETLERİ	PGSUS		PGSUS			2.286,00	63,86	17/12/19			86,40		197.510,40	1,4	0,19	
HİSSE SENETLERİ	PGSUS		PGSUS			2.000,00	84,65	30/12/19			86,40		172.800,00	1,22	0,16	
HİSSE SENETLERİ	SAHOL		SAHOL			54.019,00	8,27	26/12/19			9,54		515.341,26	3,65	0,49	
HİSSE SENETLERİ	SISE		SISE			47.908,66	4,78	13/12/19			5,27		252.478,64	1,79	0,24	
HİSSE SENETLERİ	SODA		SODA			45.500,36	6,54	18/12/19			6,18		281.192,24	1,99	0,26	
HİSSE SENETLERİ	TAV		TAVHL			9.426,00	24,12	13/12/19			29,18		275.050,68	1,95	0,26	
HİSSE SENETLERİ	TAV		TAVHL			-4.000,00	24,12	30/12/19			29,18		-116.720,00	-0,83	-0,11	
HİSSE SENETLERİ	TCELL		TCELL			50.000,00	11,99	18/12/19			13,80		690.000,00	4,89	0,65	
HİSSE SENETLERİ	THYAO		THYAO			45.000,00	13,46	18/12/19			14,46		650.700,00	4,61	0,61	
HİSSE SENETLERİ	THYAO		THYAO			30.000,00	14,35	31/12/19			14,46		433.800,00	3,07	0,41	
HİSSE SENETLERİ	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.		TKFEN			11.293,00	21,20	13/12/19			19,32		218.180,76	1,55	0,2	
HİSSE SENETLERİ	TOASO		TOASO			7.500,00	20,28	20/12/19			26,86		201.450,00	1,43	0,19	
HİSSE SENETLERİ	TOASO		TOASO			5.000,00	26,84	31/12/19			26,86		134.300,00	0,95	0,13	
HİSSE SENETLERİ	TRKCM		TRKCM			45.159,80	3,09	13/12/19			3,50		158.059,30	1,12	0,15	
HİSSE SENETLERİ	TSKB		TSKB			0,02	1,05	13/11/19			1,21		0,02	0	0	
HİSSE SENETLERİ	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.		TTKOM			45.228,00	5,02	17/12/19			7,37		333.330,36	2,36	0,31	
HİSSE SENETLERİ	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.		TTKOM			20.000,00	7,44	31/12/19			7,37		147.400,00	1,04	0,14	
HİSSE SENETLERİ	TUPRS		TUPRS			7.250,00	122,83	30/12/19			126,80		919.300,00	6,51	0,87	
HİSSE SENETLERİ	TUPRS		TUPRS			-1.250,00	122,83	30/12/19			126,80		-158.500,00	-1,12	-0,15	
HİSSE SENETLERİ	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.		VAKBN			31.041,00	4,39	13/12/19			5,51		171.035,91	1,21	0,16	
HİSSE SENETLERİ	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.		VAKBN			20.000,00	5,32	31/12/19			5,51		110.200,00	0,78	0,1	
HİSSE SENETLERİ	YATAS		YATAS			15.005,00	4,77	19/12/19			7,34		110.136,69	0,78	0,1	
HİSSE SENETLERİ	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.		YKBNK			181.794,04	2,11	13/12/19			2,48		450.849,22	3,19	0,42	
HİSSE SENETLERİ	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.		YKBNK			-50.000,00	2,11	31/12/19			2,48		-124.000,00	-0,88	-0,12	
GRUP TOPLAMI						1.503.785,26							14.111.195,75	100	13,26	
GRUP TOPLAMI						1.503.785,26							14.111.195,75	100	13,26	

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
STANDART 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	Tanım	Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
Devlet Tahvili	HAZINE	15/01/20	TRT150120T16	2284,38%		1.825.000,00	94,97	26/12/19	10,57747		104,84		1.913.419,03	2,32	1,80
Devlet Tahvili	HAZINE	05/02/20	TRT050220T17	9570,00%		500.000,00	96,46	20/12/19	1054,14%		102,71		513.541,01	0,62	0,48
Devlet Tahvili	HAZINE	13/05/20	TRT130520T14	8981,20%		8.600.000,00	80,17	19/08/19	1066,51%		96,37		8.288.228,81	10,09	7,80
Devlet Tahvili	HAZINE	10/06/20	TRT100620T16	9519,00%		3.070.000,00	92,28	19/12/19	10,99676		95,50		2.931.920,43	3,56	2,76
Devlet Tahvili	HAZINE	08/07/20	TRT080720T19	9910,00%		600.000,00	96,96	25/12/19	10,80758		103,97		623.833,43	0,76	0,59
Devlet Tahvili	HAZINE	12/08/20	TRT120820T12	1714,68%		300.000,00	111,02	26/04/19	10,7127		116,12		348.346,13	0,42	0,33
Devlet Tahvili	HAZINE	16/09/20	TRT160920T25	92,673		4.600.000,00	84,27	31/12/19	11,30744		92,68		4.263.289,07	5,17	4,01
Devlet Tahvili	HAZINE	07/10/20	TRT071020T23	0,00%		5.000.000,00	90,73	20/12/19	11,274		92,13		4.606.598,03	5,59	4,33
Devlet Tahvili	HAZINE	17/02/21	TRT170221T12	9920,00%		7.500.000,00	101,15	20/12/19	11,44584		103,46		7.759.553,53	9,41	7,30
Devlet Tahvili	HAZINE	21/04/21	TRT210421T14	0,00%		1.500.000,00	107,26	02/07/19	1147,45%		115,54		1.733.150,57	2,10	1,63
Devlet Tahvili	HAZINE	22/09/21	TRT220921T18	9605,00%		6.500.000,00	94,11	03/12/19	1161,48%		99,28		6.453.192,15	7,83	6,07
Devlet Tahvili	HAZINE	20/10/21	TRT201021T25	10355,00%		5.000.000,00	104,34	24/12/19	1176,99%		106,41		5.320.572,04	6,46	5,00
Devlet Tahvili	HAZINE	12/01/22	TRT120122T17	0,00%		1.046.000,00	89,33	03/07/19	1167,61%		101,14		1.057.920,17	1,28	0,99
Devlet Tahvili	HAZINE	02/03/22	TRT020322T17	1351,10%		1.500.000,00	95,71	26/04/19	1170,97%		102,90		1.543.458,32	1,87	1,45
Devlet Tahvili	HAZINE	17/08/22	TRT170822T15	1240,58%		2.000.000,00	97,34	26/04/19	1176,56%		102,31		2.046.223,59	2,48	1,92
Devlet Tahvili	HAZINE	14/09/22	TRT140922T17	0,00%		1.828.000,00	85,56	02/07/19	1143,70%		96,48		1.763.738,90	2,14	1,66
Devlet Tahvili	HAZINE	18/01/23	TRT180123T10	1857,22%		3.700.000,00	86,38	13/12/19	1165,91%		107,64		3.982.588,10	4,83	3,75
Devlet Tahvili	HAZINE	08/03/23	TRT080323T10	10,8152		258.000,00	89,32	23/12/19	11,91871		90,55		233.626,55	0,28	0,22
Devlet Tahvili	HAZINE	14/06/23	TRT140623T19	1679,76%		2.000.000,00	103,89	26/04/19	1169,63%		114,21		2.284.132,03	2,77	2,15
Devlet Tahvili	HAZINE	27/09/23	TRT270923T11	1149,22%		1.000.000,00	91,39	24/12/19	1180,77%		94,28		942.808,33	1,14	0,89
Devlet Tahvili	HAZINE	20/03/24	TRT200324T13	0,00%		300.000,00	92,76	12/12/19	1185,97%		99,17		297.523,34	0,36	0,28
Devlet Tahvili	HAZINE	24/07/24	TRT240724T15	1274,12%		3.046.000,00	88,06	26/04/19	1223,77%		93,94		2.861.312,29	3,47	2,69
Devlet Tahvili	HAZINE	12/03/25	TRT120325T12	1553,72%		342.000,00	72,35	07/11/19	1213,72%		87,94		300.770,51	0,36	0,28
Devlet Tahvili	HAZINE	11/02/26	TRT110226T13	0,00%		2.300.000,00	90,20	16/12/19	1237,92%		97,95		2.252.811,42	2,73	2,12
Devlet Tahvili	HAZINE	24/02/27	TRT240227T17	0,00%		2.200.000,00	83,36	19/12/19	1237,14%		98,94		2.176.781,52	2,64	2,05
Devlet Tahvili	HAZINE	11/08/27	TRT110827T16	7790,00%		2.000.000,00	85,45	12/11/19	1232,83%		96,74		1.934.776,22	2,35	1,82
Devlet Tahvili	HAZINE	08/03/28	TRT080328T15	1599,04%		1.500.000,00	84,48	26/04/19	1235,10%		105,81		1.587.101,30	1,93	1,49
GRUP TOPLAMI						70.015.000,00							70.021.216,82	84,96	65,86

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
STANDART 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/	Aks	Aks	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanım	Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
Finansman Bonosu	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	17/03/20	TRFGAN32011	24,00		3.130.000,00	100,00	12/12/19			100,88		3.157.573,85	3,83	2,97
Finansman Bonosu	AKBANK T.A.Ş.	26/03/20	TRFAKBK32013	2,00		6.000.000,00	100,00	25/12/19			100,20		6.012.299,26	7,29	5,65
Finansman Bonosu	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	20/04/20	TRFGAN42010	24,00		3.130.000,00	100,00	20/12/19			100,36		3.141.218,16	3,81	2,95
GRUP TOPLAMI						12.260.000,00							12.311.091,27	14,93	11,57
Özel Sektör Tahvil	AKY TURKCELL VFF	27/04/20	TRSAKYP41612	80,48		85.628,00	100,00	26/04/19			105,14		90.030,14	0,11	0,09
GRUP TOPLAMI						85.628,00							90.030,14	0,11	0,09
GRUP TOPLAMI						12.345.628,00							12.401.121,41	15,04	11,66
GRUP TOPLAMI						82.360.628,00							82.422.338,23	100,00	77,52
T.REPO	HAZİNE	02/01/20	TRT050624T35	11,30		1.000.619,18	11,30	31/12/19		905.665,00	11,38		1.000.307,35	100,00	0,94
GRUP TOPLAMI						1.000.619,18							1.000.307,35	100,00	0,94
GRUP TOPLAMI						1.000.619,18							1.000.307,35	100,00	0,94
MEVDUAT	AKBANK T.A.Ş.	08/01/20				1.152.969,40		29/11/19			12,00		1.165.422,68	13,52	1,10
MEVDUAT	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	06/02/20				3.190.839,04		23/12/19			10,50		3.198.965,96	37,12	3,01
MEVDUAT	AKBANK T.A.Ş.	07/02/20				2.025.643,84		30/12/19			10,50		2.026.743,26	23,52	1,91
MEVDUAT	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	13/02/20				2.226.178,08		30/12/19			10,40		2.227.363,66	25,84	2,10
GRUP TOPLAMI						8.595.630,36							8.618.495,56	100,00	8,12
GRUP TOPLAMI						8.595.630,36							8.618.495,56	100,00	8,12
TPP		02/01/20		10,90		170.101,53	10,90	31/12/19			10,78		170.051,31	100,00	0,16
GRUP TOPLAMI						170.101,53							170.051,31	100,00	0,16
GRUP TOPLAMI						170.101,53							170.051,31	100,00	0,16
FON PORTFÖY DEĞERİ													106.322.388,20		100,00

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
STANDART 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	106.322.388		100,85	85.796.401	-	107,08
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	106.322.388		100,85	85.796.402	-	107,08
B,HAZIR DEĞERLER	24.526		0,02	37.111	-	0,05
a) Kasa	-	0	0	-	-	-
b) Bankalar	24.526	100,00	0,02	37.111	100,00	0,05
c) Diğer Hazır Değerler	-	0	0	-	-	-
C,ALACAKLAR	654.219		0,62	142.426	-	0,18
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	352.070		0,00	118.638	83,30	0,15
c) Takastan BPP Alacakları	271.091		0	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	31.058		0,03	23.788	16,70	0,03
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(1.570.261)		-1,49	(5.762.547)	-	7,19
a) Takasa Borçlar T1				(4.066.645)	70,57	5,08
b) Takasa Borçlar T2	(1.313.540)	83,65	-1,25	(1.562.766)	27,12	1,95
c) Yönetim Ücreti	(160.650)	10,23	-0,15	(126.713)	2,20	0,16
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Kayda Alma	(3.163)	0,20146	-0,00300053	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(92.909)	6,12	-0,09	(6.422)	0,11	0,01
F. MD Düşüş Karşılığı		-		90.030	-	0,11
Fon toplam değeri	105.430.872		100,00%	80.123.361		100,00