

**ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. KATILIM 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.
KATILIM 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. Katılım 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. Katılım 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.
KATILIM 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	AKSUE		AKSUE			576	14,36	27/12/19			14,87		8565,12	0,62%	0,09%
HİSSE SENETLERİ	ALCAR		ALCAR			130,0000	52,9	27/12/19			60		7800	0,56%	0,09%
HİSSE SENETLERİ	ALCTL		ALCTL			1.124,0000	12,26	27/12/19			12,04		13532,96	0,98%	0,15%
HİSSE SENETLERİ	ALKA		ALKA			5.956,0000	5,120915	27/12/19			5,58		33234,48	2,39%	0,36%
HİSSE SENETLERİ	ALKIM		ALKIM			1.013,0000	31,622646	27/12/19			38,32		38818,16	2,80%	0,42%
HİSSE SENETLERİ	BANVT		BANVT			3.182,0000	16,189827	27/12/19			18,57		59.089,74	4,26%	0,64%
HİSSE SENETLERİ	BFREN		BFREN			25,0000	213,0556	27/12/19			289,9		7247,5	0,52%	0,08%
HİSSE SENETLERİ	BIMAS		BIMAS			2.343,0000	44,656347	27/12/19			46,66		109.324,38	7,88%	1,19%
HİSSE SENETLERİ	BUCIM		BUCIM			1.624,0000	5,94	27/12/19			6,23		10117,52	0,73%	0,11%
HİSSE SENETLERİ	CEMTS		CEMTS			3.389,0000	6,071614	27/12/19			8,28		28060,92	2,02%	0,31%
HİSSE SENETLERİ	CUSAN		CUSAN			2.126,0000	3,24	27/12/19			3,19		6781,94	0,49%	0,07%
HİSSE SENETLERİ	DESPEC BİLGİSAYAR PAZARLAMA VE TİCARET A.Ş.		DESPC			1.648,0000	4,19	27/12/19			4,24		6987,52	0,50%	0,08%
HİSSE SENETLERİ	EGEEN		EGEEN			176,0000	487,314773	27/12/19			580,5		102.168,00	7,36%	1,12%
HİSSE SENETLERİ	EGGUB		EGGUB			542,0000	38,011919	12/11/19			49,8		26991,6	1,94%	0,30%
HİSSE SENETLERİ	EGSER		EGSER			1.852,0000	3,73	27/12/19			3,71		6.870,92	0,50%	0,07%
HİSSE SENETLERİ	ERBOS		ERBOS			0,1570	15,414013	03/07/19			24,98		3,92	0,00%	0,00%
HİSSE SENETLERİ	EREGL		EREGL			15.844,0000	6,948951	27/12/19			9,04		143229,76	10,30%	1,56%
HİSSE SENETLERİ	FMIZP		FMIZP			412,0000	46,7	27/12/19			49,88		20.550,56	1,48%	0,22%
HİSSE SENETLERİ	FONET		FONET			3.259,0000	3,253007	27/12/19			7,69		25061,71	1,81%	0,27%
HİSSE SENETLERİ	FROTO		FROTO			1.772,0000	62,045412	27/12/19			70,85		125546,2	9,05%	1,37%
HİSSE SENETLERİ	GENTS		GENTS			7.652,5000	2,149948	27/12/19			2,19		16758,98	1,21%	0,18%
HİSSE SENETLERİ	ISKENDERUN DEMİR ÇELİK		ISDMR			13.548,0000	7,144146	27/12/19			8,01		108519,48	7,82%	1,19%
HİSSE SENETLERİ	JANTSA JANT SANAYİ VE TİC. A.Ş.		JANTS			864,0000	51,261713	27/12/19			58,3		50371,2	3,63%	0,55%
HİSSE SENETLERİ	KARTN		KARTN			54,0000	348,588889	27/12/19			389,9		21054,6	1,52%	0,23%
HİSSE SENETLERİ	KFEIN YAZILIM		KFEIN			1.595,0000	11,22	27/12/19			11,14		17768,3	1,28%	0,19%
HİSSE SENETLERİ	KNFRT		KNFRT			900,0000	7,845122	27/12/19			7,82		7038	0,51%	0,08%
HİSSE SENETLERİ	KONYA		KONYA			32,0000	265,4	27/12/19			271,3		8681,6	0,63%	0,09%
HİSSE SENETLERİ	KRON TELEKOM A.Ş.		KRONT			531,0000	12,98	27/12/19			12,72		6754,32	0,49%	0,07%
HİSSE SENETLERİ	LOGO		LOGO			2.029,0000	47,518945	27/12/19			60,8		123363,2	8,89%	1,35%
HİSSE SENETLERİ	MAVİ JEANS		MAVİ			1.703,0000	43,9968	27/12/19			57,9		98603,7	7,11%	1,08%
HİSSE SENETLERİ	ORGE ENERJİ TAHAH.A.Ş.		ORGE			10.617,0000	4,61432	27/12/19			4,96		52660,32	3,79%	0,58%
HİSSE SENETLERİ	PETUN		PETUN			4.712,0000	8,503644	27/12/19			9,17		43209,04	3,11%	0,47%
HİSSE SENETLERİ	SASA		SASA			0,9160	6,703057	08/05/19			7,73		7,08	0,00%	0,00%
HİSSE SENETLERİ	SELEC		SELEC			7.501,0000	5,432953	27/12/19			6,1		45756,1	3,30%	0,50%
HİSSE SENETLERİ	ULUSOY ELEKTRİK İMALAT TAHHÜT VE TİCARET A.Ş.		ULUSE			271,0000	25,52	27/12/19			26,6		7208,6	0,52%	0,08%
HİSSE SENETLERİ	YATAS		YATAS			0,9990	4,514515	03/07/19			7,34		7,33	0,00%	0,00%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM 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
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)
GRUP TOPLAMI						99.004,57			0,00%				1.387.744,76	100,00%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	12/02/20	TRD120220T16	1,00%		370.000,00	104,6182	31/12/19	9,45%		105,2600504		389462,19	5,01%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	23/09/20	TRD230920T24	1,10%		670.000,00	114,1298	14/11/19	10,18%		116,4799133		780415,42	10,05%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	18/11/20	TRD181120T19	1,07%		750.000,00	107,6812	29/11/19	10,54%		108,3457393		812593,04	10,46%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	10/02/21	TRD100221T17	1,04%		650.000,00	103,3218	26/09/19	10,97%		113,8534743		740047,58	9,53%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	16/06/21	TRD160621T17	1,13%		700.000,00	112,7728	31/10/19	9,96%		115,9971662		811.980,16	10,45%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	14/07/21	TRD140721T18	0,98%		470.000,00	97,2134	14/11/19	9,88%		104,0239		488.912,12	6,29%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	18/08/21	TRD180821T13	1,08%		1.760.000,00	105,0231	10/12/19	9,89%		113,0291839		1.989.313,64	25,61%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	15/12/21	TRD151221T10	1,02%		900.000,00	100,5961	20/12/19	10,12%		103,3222745		929.900,47	11,97%
KİRA SERTİFİKALARI	HAZİNE	10/08/22	TRD100822T10	0,98%		340.000,00	98,2976	11/11/19	10,02%		106,3868295		361.715,22	4,66%
GRUP TOPLAMI				0,00%		6.610.000,00			0,00%				7.304.339,84	94,03%
Özel Sektör Kira Sertifikaları	ZİRAAT KATILIM VK	14/01/20	TRDZKVK12023	1,00%		450.000,00	101,3025	22/11/19	10,45%		103,08319		463.874,36	5,97%
GRUP TOPLAMI						450.000,00							463.874,36	5,97%
GRUP TOPLAMI						7.060.000,00							7.768.214,20	100,00%
FON PORTFÖY DEĞERİ													9.155.958,96	0,00%

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ

(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	9.155.959		94,60	1.392.498	100,00	99,90
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	9.155.959		94,60	1.392.498	100,00	99,90
B,HAZIR DEĞERLER	523.429		5,41	7.700	100,00	0,55
a) Kasa	-	0	0,00	-	-	-
b) Bankalar	523.429	100,00	5,41	7.700	100,00	0,55
c) Diğer Hazır Değerler	-	0	0,00	-	-	-
C,ALACAKLAR	16.063		0,17	7.092		0,01
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
e) Peşin Ödenen Giderler	-	-	-	-	-	-
f) Diğer alacaklar	16.063		0,17	7.092	100	0,51
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(16.498)		(0,17)	(4.033)	(100,00)	0,00
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(14.035)	85,07	(0,15)	(2.043)	(50,66)	(0,15)
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Kayda Alma	(290)	1,760234496	0,00	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(2.173)	14,93	(0,02)	(1.990)	(49,34)	(0,14)
Fon toplam değeri	9.678.952		100,00	1.403.257		100,00