

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN
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.
OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN 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. OKS Agresif Katılım Değişken 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. OKS Agresif Katılım Değişken 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.
OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN 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			632	11,2	03/12/19			14,87		9397,84	0,73%	0,43%
HİSSE SENETLERİ		ALCAR		ALCAR			123,00	48,44	03/12/19			60,0000		7.380,00	0,58%	0,34%
HİSSE SENETLERİ		ALCTL		ALCTL			800,00	11,57025	27/12/19			12,04		9.632,00	0,75%	0,45%
HİSSE SENETLERİ		ALKA		ALKA			5.200,00	4,656842	27/12/19			5,58		29.016,00	2,27%	1,34%
HİSSE SENETLERİ		ALKIM		ALKIM			900,00	28,484011	31/12/19			38,32		34.488,00	2,69%	1,59%
HİSSE SENETLERİ		BANVT		BANVT			3.027,00	15,185732	03/12/19			18,57		56.211,39	4,39%	2,59%
HİSSE SENETLERİ		BFREN		BFREN			26,00	214,593846	12/12/19			289,90		7.537,40	0,59%	0,35%
HİSSE SENETLERİ		BIMAS		BIMAS			2.161,00	41,16192	03/12/19			46,66		100.832,26	7,88%	4,65%
HİSSE SENETLERİ		BUCIM		BUCIM			1.050,00	5,6	03/12/19			6,23		6.541,50	0,51%	0,30%
HİSSE SENETLERİ		CEMTS		CEMTS			3.260,00	5,458641	12/12/19			8,28		26.992,80	2,11%	1,25%
HİSSE SENETLERİ		CUSAN		CUSAN			2.060,00	2,86	03/12/19			3,19		6.571,40	0,51%	0,30%
HİSSE SENETLERİ		DESPEC BİLGİSAYAR PAZARLAMA VE TİCARET A.Ş.		DESPC			1.534,00	3,83	03/12/19			4,24		6.504,16	0,51%	0,30%
HİSSE SENETLERİ		EGEEN		EGEEN			182,00	490,176923	03/12/19			580,50		105.651,00	8,25%	4,88%
HİSSE SENETLERİ		EGGUB		EGGUB			704,00	38,957727	12/11/19			49,80		35.059,20	2,74%	1,62%
HİSSE SENETLERİ		EGSER		EGSER			1.693,00	3,47	03/12/19			3,71		6.281,03	0,49%	0,29%
HİSSE SENETLERİ		EREGL		EREGL			14.200,00	6,931071	31/12/19			9,04		128.368,00	10,03%	5,92%
HİSSE SENETLERİ		FONET		FONET			4.000,00	3,178608	27/12/19			7,69		30.760,00	2,40%	1,42%
HİSSE SENETLERİ		FROTO		FROTO			1.600,00	60,6122	30/12/19			70,85		113.360,00	8,85%	5,23%
HİSSE SENETLERİ		GENTS		GENTS			7.833,00	1,874531	12/12/19			2,19		17.154,27	1,34%	0,79%
HİSSE SENETLERİ		ISKENDERUN DEMİR CELİK		ISDMR			12.640,00	6,625222	03/12/19			8,01		101.246,40	7,91%	4,67%
HİSSE SENETLERİ		JANTSA JANT SANAYİ VE TİC. A.Ş.		JANTS			758,00	52,960686	03/12/19			58,3		44.191,40	3,45%	2,04%
HİSSE SENETLERİ		KARTN		KARTN			53,0000	328,275472	03/12/19			389,9		20.664,70	1,61%	0,95%
HİSSE SENETLERİ		KFEIN YAZILIM		KFEIN			2.000,0000	10,29	30/12/19			11,14		22.280,00	1,74%	1,03%
HİSSE SENETLERİ		KNFRT		KNFRT			2.000,00	8,248385	27/12/19			7,82		15.640,00	1,22%	0,72%
HİSSE SENETLERİ		KONYA		KONYA			25,00	233,8	12/12/19			271,3		6.782,50	0,53%	0,31%
HİSSE SENETLERİ		KRON TELEKOM A.Ş.		KRONT			497,00	11,86	03/12/19			12,72		6.321,84	0,49%	0,29%
HİSSE SENETLERİ		LOGO		LOGO			1.952,00	41,538253	27/12/19			60,8		118.681,60	9,27%	5,48%
HİSSE SENETLERİ		MAVİ JEANS		MAVİ			1.400,00	42,433807	27/12/19			57,9		81.060,00	6,33%	3,74%
HİSSE SENETLERİ		ORGE ENERJİ TAHAHA.Ş.		ORGE			9.500,00	4,22176	27/12/19			4,96		47.120,00	3,68%	2,18%
HİSSE SENETLERİ		PETUN		PETUN			3.386,00	8,11319	03/12/19			9,17		31.049,62	2,43%	1,43%
HİSSE SENETLERİ		SELEC		SELEC			6.793,00	5,363679	03/12/19			6,1		41.437,30	3,24%	1,91%
HİSSE SENETLERİ		ULUSOY ELEKTRİK İMALAT TAAHHÜT VE TİCARET A.Ş.		ULUSE			231,00	25,56	03/12/19			26,6		6.144,60	0,48%	0,28%
HİSSE SENETLERİ		YATAS		YATAS			0,50	4,509018	03/07/19			7,34		3,66	0,00%	0,00%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN 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	(%)	(%)
GRUP TOPLAMI						92220,499							1280361,87	100,00%	59,07%
GRUP TOPLAMI						92.220,50							1.280.361,87	100,00%	59,07%
Döviz	EU		EUR			524,65	6,22	31/12/19			6,66		3.495,27	0,00%	0,00%
Döviz	FED		USD			2.202,00	5,89	31/12/19			5,94		13.079,88	0,00%	0,00%
GRUP TOPLAMI						2.726,65							16.575,15	0,00%	0,00%
GRUP TOPLAMI				0,00%		2.726,65							16.575,15	0,00%	0,00%
KİRA SERTİFİKALARI				0,00%										0,00%	0,00%
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	12/02/20	TRD120220T16	100,40%		180.000,00	104,3087	27/12/19	9,454941		105,2600504		189.468,09	21,38%	8,74%
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	18/11/20	TRD181120T19	19,34%		20.000,00	105,7525	27/08/19	10,538588		108,3457393		21.669,15	2,44%	1,00%
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	05/02/21	TRD050221F10	100,24%		30.000,00	101,2428	14/06/19	2,418369		101,697165		203.255,00	22,93%	9,41%
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	16/06/21	TRD160621T17	111,00%		20.000,00	116,333	19/09/19	9,957325		115,9971662		23.199,43	2,62%	1,07%
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	14/07/21	TRD140721T18	99,50%		150.000,00	101,1736	12/12/19	9,87891		104,0238552		156.035,78	17,61%	7,20%
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	18/08/21	TRD180821T13	107,70%		60.000,00	112,8231	25/12/19	9,886721		113,0291839		67.817,51	7,65%	3,13%
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları	HAZİNE	10/08/22	TRD100822T10	80,00%		40.000,00	82,5126	09/05/19	10,021908		106,3868295		42.554,73	4,80%	1,96%
GRUP TOPLAMI				0,00%										0,00%	0,00%
Özel Sektör Kira Sertifikaları	VAKIF VKŞ	12/02/20	TRDVVRK22018	3,09%		110.000,00	100	06/11/19	9,896317		101,9743586		112.171,79	12,66%	5,18%
Özel Sektör Kira Sertifikaları	ZİRAAT KATILIM VK	03/04/20	TRDZKVK42012	2,66%		70.000,00	100	27/12/19	10,263929		100,1339442		70.093,76	7,91%	3,24%
GRUP TOPLAMI						180.000,00							182.265,55	20,57%	8,42%
GRUP TOPLAMI						680.000,00							886.265,24	100,00%	40,93%
FON PORTFÖY DEĞERİ													2.166.627,11	0,00%	100,00%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN 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	2.166.627	-	0,94	769.284	-	98,00
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	2.166.627	-	0,94	769.284	-	98,00
B,HAZIR DEĞERLER	154.423	-	0,07	8.200	-	1,04
a) Kasa	-	-	0,00	-	-	-
b) Bankalar	137.848	1,00	0,06	8.200	100,00	1,04
c) Diğer Hazır Değerler	16.575	-	0,01	-	-	-
C,ALACAKLAR	11.415	-	0,00	10.275	-	1,31
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	11.415	1,00	0,00	10.275	100,00	1,31
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(15.291)	-	-0,01	(2.811)	-	-0,36
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(1.477)	0,10	0,00	(574)	-20,43	-0,07
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Kayda alma	(70)	0,00	0,00	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(13.745)	0,90	-0,01	(2.237)	-79,57	-0,29
Fon toplam değeri	2.317.174		100,00%	784.948		100,00%