

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM 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 YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM 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 Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Katılım 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 Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Katılım 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 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 KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	Birim		Günlük			
Menkul	Vade	Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	Alış	Değerleme	Birim	Günlük	Toplam	Grup
Kıymet	Tarihi	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Fiyatı	Fiyatı	Deger	Kur	Deger	(%)
HS		12/18/2018	ALKA			1375			4.089091	5.58	7672.5		0.71	6.32
HS			ALKIM			200			25.6149	38.32	7664		0.71	6.31
HS			BIMAS			140			42.470793	46.66	6532.4		0.6	5.38
HS			BUCIM			1250			4.5846	6.23	7787.5		0.72	6.41
HS			CEMTS			935			5.184545	8.28	7741.8		0.71	6.37
HS			DENCM			750			4.451343	8.34	6,255.00		0.58	5.15
HS			EGEEN			12			473.80833	580.5	6966		0.64	5.73
HS			EREGL			1010			7.237129	9.04	9130.4		0.84	7.52
HS			FROTO			100			56.8319	70.85	7085		0.65	5.83
HS			GENTS			3500.077			1.333569	2.19	7,665.17		0.71	6.31
HS			HLGYO			6,000.00			0.865417	1.22	7,320.00		0.67	6.03
HS			ISDMR			1,150.00			6.798843	8.01	9,211.50		0.85	7.58
HS			LOGO			140.00			37.903464	60.8	8,512.00		0.78	7.01
HS			MAVI			140.00			36.611914	57.9	8,106.00		0.75	6.67
HS			ORGE			1,250.00			3.608	4.96	6,200.00		0.57	5.1
HS			SELEC			1,250.00			4.815973	6.1	7,625.00		0.7	6.28
Toplam						19,202.08					121,474.27		11.18	0
GRUP TOPLAMI						19,202.08					121,474.27		11.18	0
KAMU-TL	12.02.2020		TRD120220T16	6.36%	2.000	130,000.00			102.31034	105.26	136,838.00		12.59	14.17
	23.09.2020		TRD230920T24	12.20%	2.000	150,000.00			112.35178	116.48	174,720.00		16.07	18.1
	23.09.2020		TRD230920T24	12.20%	2.000	70,000.00			116.5022	116.48	81,536.00		7.5	8.45
Ara Toplam			TRD230920T24			220,000.00					256,256.00		23.58	26.54
	18.11.2020		TRD181120T19	8.95%	2.000	50,000.00			114.92256	108.346	54,173.00		4.98	5.61
	10.02.2021		TRD100221T17	8.80%	2.000	90,000.00			105.78418	113.853	102,467.70		9.43	10.61
	16.06.2021		TRD160621T17	10.55%	2.000	140,000.00			109.03217	115.997	162,395.80		14.94	16.82

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul Kıymet	Vade Tarihi	Satın Alış Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	Birim Alış Fiyatı	Değerleme Fiyatı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)
	16.06.2021	13.12.2019	TRD160621T17	10.55%	2	140000			109.032172	115.997	162.395.80		14.94	16.82
	14.07.2021	03.12.2019	TRD140721T18	4.70%	2	30000			101.431333	104.024	31.207.20		2.87	3.23
	15.12.2021	25.12.2019	TRD151221T10	5.75%	2	140000			100.488172	103.322	144.650.80		13.31	14.98
	10.08.2022	13.11.2019	TRD100822T10	5.38%	2	70000			91.461955	106.387	74.470.90		6.85	7.71
Toplam						870000					962,459.40		88.55	0
ÖZEL SEKTÖR-TL	11.03.2020	06.12.2019	TRDZKVK32013	2.96%	12	3000			100	101.099	3.032.97		0.28	0.31
Toplam						3000					3,032.97		0.28	0
GRUP TOPLAMI						873000					965,492.37		88.82	0
ViOP NAKİT TEMİNAT						0					0		0	0
Toplam						0					0.00		0	0
GRUP TOPLAMI						0.00					0.00		0	0
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ						892,202.08					1,086,966.64			

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KATILIM 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 PORTFÖY DEĞERİ	1,086,967	100.00	98.58	190,294	100.00	95.77
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	1,086,967	100.00	98.58	190,294	100.00	95.77
B,HAZIR DEĞERLER	6,690	0.00	0.61	7,765	-	3.91
a) Kasa	0	0.00	0.00	-	-	-
b) Bankalar	6,690	100.00	0.61	7,765	-	3.91
c) Diğer Hazır Değerler	0	0.00	0.00	-	-	-
C,ALACAKLAR	14,141	0.00	1.28	684	100.00	0.34
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	-	-	-	684	100.00	0.34
e) Diğer Alacaklar	14,141	100.00	1.28	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(5,128)	0.00	(0.47)	(53)	(100.00)	(0.03)
a) Takasa Borçlar T1	-2,586	-50.42	-0.23	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0.00	0.00	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-290	-5.66	-0.03	-	-	-
d) Hizmet Komisyonu	0	0.00	0.00	51	(96.79)	(0.03)
e) İhtiyatlar	0	0.00	0.00	-	-	-
f) Krediler	0	0.00	0.00	-	-	-
g) Diğer Borçlar	-2,253	-43.92	(0.20)	2	(3.21)	(0.03)
Fon toplam değeri	1,102,670		100.00	198,690		100.00