

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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.
ALTIN 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. Altın 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. Altın 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.
ALTIN 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	1.633.632.436,50		101,61	797.576.753,85	-	99,96
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	1.633.634.422,42		101,61	797.576.750,25	-	99,96
B,HAZIR DEĞERLER	8.638,65		0,00	406.741,07	-	0,05
a) Kasa	0,00	0,00	0,00	-	-	-
b) Bankalar	8.638,65	100,00	0,00	406.741,07	100,00	0,05
c) Diğer Hazır Değerler	0,00	0,00	0,00	-	-	-
C,ALACAKLAR	1.730.803,00		0,11	738.431,18	-	0,09
a) Takastan Alacaklar T1	0,00	0,00	0,00	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	0,00	0,00	0,00	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0,00	0,00	0,00	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	1.730.803,00	100,00	0,11	738.431,18	100,00	0,09
D,DİĞER VARLIKLAR	0		0,00	0,00	-	0,00
E,BORÇLAR	-27.662.951,00	0,00	-1,72	-793.955	-	(0,10)
a) Takasa Borçlar T1	-26.113.595,04	-94,40	-1,62	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0,00	0,00	0,00	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-1.358.070,48	-4,91	-0,08	-683.163,67	(86,05)	(0,09)
d) Ödenecek Vergi	0,00	0,00	0,00	-	-	-
e) İhtiyatlar	0,00	0,00	0,00	-	-	-
f) Krediler	0,00	0,00	0,00	-	-	-
g) Diğer Borçlar	-191.286,09	-0,69	-0,01	-110.791	(13,95)	(0,01)
F. MD Düşüş Karşılığı	0	0	0	-	-	-
Fon toplam değeri	1.607.708.927,00		100,00%	797.927.971		100,00

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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	(%)	(%)
B.BORÇLANMA															
ARAÇLARI															
B1.ÖZEL SEKTÖR															
BORÇLANMA ARAÇLARI															
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2029	TRSYKKBK62914	6,36%	4,000	5.400.000,00	100,00	03.07.2019	0		103,057	1	5.565.078,00	100,00%	0,34%
Toplam						5.400.000,00							5.565.078,00		0,34%
GRUP TOPLAMI						5.400.000,00							5.565.078,00		0,34%
B2.KAMU SEKTÖRÜ															
BORÇLANMA ARAÇLARI															
KUPONLU DEVLET TAH.	T.C. Hazine Müsteşarlığı	24.02.2021	TRT240221T13	1,00%	2,00	482.575,00	22.682,06	27.02.2019			29.076,58	1,00	140.316.325,24	49,39%	8,59%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.09.2021	TRT170921T15	1,00%	2,000	497.500,00	27.279,86	20.09.2019			28899,693	1	143775972,7	50,61%	8,80%
Toplam						980.075,00							284.092.297,92		17,39%
GRUP TOPLAMI						980.075,00							284.092.297,92		17,39%
TOPLAM						6.380.075,00							289.657.375,92		17,73%
C.KİRA															
SERTİFİKALARI															
KAMU-TL	T.C. Hazine Müst. Varlık Kiralama	18.06.2021	TRD180621T15	1,00%	2,00	447.750,00	25261,523	21.06.2019	0,00%		28.756,27	1,00	128.756.198,93	0,4724	7,88%
	T.C. Hazine Müst. Varlık Kiralama	17.09.2021	TRD170921T13	1,00%	2,000	497.500,00	27.279,86	20.09.2019	0,00%		28899,693	1	143.775.972,68	52,76%	8,80%
Toplam						945.250,00							272.532.171,60		16,68%
GRUP TOPLAMI						945.250,00							272.532.171,60		16,68%
Ç. TÜREV ARAÇLAR						21.048.992,00							21.048.992,00	0,1214	1,29%
VIOP NAKİT TEMİNAT						21.048.992,00							21.048.992,00		1,29%
Toplam		02.01.2020	USD/TL	0,00%	0,000	4.388.222,00	5,95	31.12.2019	0		5,95	1,00	26.089.735,08	0	0

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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/	Abs	Abs	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
OTC FORWARD		02.01.2020	USD/TL	0	0	4388222	5,9495	31.12.2019	0		5,9454	1	26089735,08	0	0
VIOP SÖZLEŞMESİ															
Uzun Pozisyon			F_USDTRY0220			12.300,00	6,04	30.12.2019			6,0467	1	0,00	0,00%	0,00%
			F_XAUUSD0220			5.717,00	1.525,14	30.12.2019			1527,45	5,94	0,00	0,00%	0,00%
Ara Toplam													0,00		0,00%
Toplam													0,00		0,00%
GRUP TOPLAMI						21.048.992,00							0,00		0,00%
E.ALTIN VE DİĞER															
KIYMETLİ															
MADENLER															
ALTIN			ALTIN			2.805,00	202.720,26	26.12.2019			285937,23	1	802053930,2	96,85%	49,10%
			ALTIN			90,00	290.151,05	02.01.2020			289629,33	1	26.066.639,70	3,15%	1,60%
Ara Toplam			ALTIN			2.895,00							828.120.569,85	100,00%	50,69%
Toplam						2.895,00							828.120.569,85		50,69%
GRUP TOPLAMI						2.895,00							828.120.569,85		50,69%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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	İhracı	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	(%)	(%)	
G.DİĞER																
VARLIKLAR																
BYF KATILMA PAYLARI	GMSTR Finans Portföy Günlük Borsa Yatırım Fonu		GMSTRF			220.000,00	21,55	24.10.2019			22,65		4.983.220,00	2,24%	0,31%	
Toplam						220.000,00							4.983.220,00			0,31%
TERS REPO - DT		02.01.2020	TRT020823T11	11,25%		10.006.164,38	194,74	31.12.2019	0,119	5.135.085,00	194,798756	1	10.003.081,72	4,50%	0,61%	
		02.01.2020	TRT020823T11	0,1125		4.502.773,97	194,74	31.12.2019	0,119	2.310.795,00	194,798187	1	4.501.386,77	0,0203	0,28%	
		02.01.2020	TRT020823T11	11,25%		1.500.924,66	194,74	31.12.2019	11,90%	770.270,00	194,796923	1	1.500.462,26	0,68%	0,09%	
		02.01.2020	TRT020823T11	11,25%		5.003.082,19	194,74	31.12.2019	0,119	2.567.545,00	194,798567	1	5.001.540,86	2,25%	0,31%	
		02.01.2020	TRT020823T11	0,1125		10.006.164,38	194,74	31.12.2019	0,119	5.135.085,00	194,80	1,00	10.003.081,72	4,50%	0,61%	
		02.01.2020	TRT020823T11	11,25%		5.003.082,19	194,74	31.12.2019	0,119	2.567.545,00	194,80	1,00	5.001.540,86	2,25%	0,31%	
Ara Toplam			TRT020823T11			36.022.191,77							36011094,19	16,20%	2,20%	
		02.01.2020	TRT050624T19	11,25%		500.308,22	99,99	31.12.2019	11,90%	500.060,00	100,018816	1	500.154,09	0,23%	0,03%	
		02.01.2020	TRT050624T19	11,25%		500.308,22	99,99	31.12.2019	0,119	500.060,00	100,02	1,00	500.154,09	0,23%	0,03%	
		02.01.2020	TRT050624T19	11,25%		10.006.164,38	99,99	31.12.2019	0,119	10.001.065,00	100,02	1,00	10.003.081,72	4,50%	0,61%	
Ara Toplam			TRT050624T19			11.006.780,82							11.003.389,90	4,95%	0,67%	
		02.01.2020	TRT120325T12	11,25%		3.502.157,53	85,1864	31.12.2019	11,90%	4.108.635,00	85,21	1,00	3.501.078,60	0,0158	0,21%	
		02.01.2020	TRT120325T12	11,25%		4.002.465,75	85,1864	31.12.2019	11,90%	4.695.585,00	85,21	1,00	4.001.232,69	0,018	0,24%	
		02.01.2020	TRT120325T12	11,25%		4.502.773,97	85,19	31.12.2019	11,90%	5.282.530,00	85,212706	1	4.501.386,77	2,03%	0,28%	
Ara Toplam			TRT120325T12			12.007.397,25							12.003.698,06	5,40%	0,73%	
Toplam						59.036.369,84							59.018.182,15			3,61%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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	Alın	Alın	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tamamı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
BPP		02.01.2020		10,85%	0,00	381.226,51	100000	31.12.2019	11,46%		100.029,72	1,00	381.113,24	0,0017	0,02%
Toplam						381.226,51							381.113,24		0,02%
VADELİ MEVD-YP	THL	05.02.2020	180	1,00%		275,00	0,00	09.08.2019			285937,23	276,0912	78.944.758,09	35,52%	4,83%
	YKB	05.02.2020	181	1,00%		275,00	0,00	08.08.2019			285937,23	276,0957	78.946.053,66	35,52%	4,83%
Toplam						550,00							157.890.811,75		9,67%
GRUP TOPLAMI						59.638.146,35				43574260			222.273.327,14		13,61%
FONORTAKLIK PORTFÖY DEGERİ						66.966.366,35				43574260			1.633.632.436,50		