

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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.
ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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. Ata Finans Dengeli Değişken Grup 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. Ata Finans Dengeli Değişken Grup 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.

Diğer Husus

Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 17 Şubat 2020 tarih ve E.1961 sayılı izin çerçevesinde; Fon, 27 Mart 2020 tarihi itibarıyla Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Ata Finans Dinamik Değişken Grup Emeklilik Yatırım Fonu ile birleşmiştir.

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. ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	(%)	(%)
A.PAY	AG Anadolu Grubu Holding		AGHOL			806,00	14,03	04.12.2019			17,59		14.177,54	3,44%	0,51%
	Akbank		AKBNK			2.450,00	6,69	04.12.2019			8,11		19.869,50	4,82%	0,72%
	Aksigorta		AKGRT			1.593,00	5,56	04.12.2019			6,09		9.701,37	2,35%	0,35%
	Alkim Kimya		ALKIM			228,00	25,65	15.10.2019			38,32		8.736,96	2,12%	0,32%
	Anadolu Cam		ANACM			3.724,85	3,04	04.12.2019			4,36		16.240,35	3,94%	0,59%
	Arçelik		ARCLK			809,00	18,00	04.12.2019			20,84		16.859,56	4,09%	0,61%
	Aygaz		AYGAZ			1.190,00	11,19	04.12.2019			12,84		15.279,60	3,71%	0,55%
	Bağfaş		BAGFS			491,00	13,95	04.12.2019			16,82		8.258,62	2,00%	0,30%
	Bizim Toptan Satış		BIZIM			1.241,00	7,98	15.10.2019			11,17		13.861,97	3,36%	0,50%
	Coca Cola İçecek		CCOLA			350,00	31,75	15.10.2019			38,70		13.545,00	3,29%	0,49%
	Çimsa Çimento		CIMSA			704,00	9,02	04.12.2019			9,08		6.392,32	1,55%	0,23%
	Doğuş Otomotiv		DOAS			874,00	9,34	04.12.2019			9,52		8.320,48	2,02%	0,30%
	Emlak Konut GYO		EKGYO			8.347,00	1,48	04.12.2019			1,46		12.186,62	2,96%	0,44%
	Ereğli Demir ve Çelik		EREGL			2.945,00	7,39	04.12.2019			9,04		26.622,80	6,46%	0,97%
	Ford Otomotiv		FROTO			108,00	58,12	04.12.2019			70,85		7.651,80	1,86%	0,28%
	Türkiye Garanti Bankası		GARAN			2.796,00	8,76	04.12.2019			11,14		31.147,44	7,56%	1,13%
	Gözde Girişim Sermayesi		GOZDE			1.830,00	3,43	04.12.2019			5,14		9.406,20	2,28%	0,34%
	İş GMYO		ISGYO			0,92	1,38	17.05.2016			1,76		1,63	0,00%	0,00%
	Mavi Giyim Sanayi ve Ticaret		MAVI			471,00	38,66	04.12.2019			57,90		27.270,90	6,62%	0,99%
	Migros Ticaret		MGROS			1.381,00	18,51	04.12.2019			24,22		33.447,82	8,12%	1,21%
	Odaş Elektrik		ODAS			5.666,00	1,62	04.12.2019			2,10		11.898,60	2,89%	0,43%
	Özak GMYO		OZKGY			5.095,00	2,30	04.12.2019			2,57		13.094,15	3,18%	0,47%
	Petkim		PETKM			0,20	3,82	06.08.2019			3,81		0,76	0,00%	0,00%
	Pegasus		PGSUS			93,00	61,16	15.10.2019			86,40		8.035,20	1,95%	0,29%
	Şişe Cam		SISE			2.548,27	5,12	04.12.2019			5,27		13.429,37	3,26%	0,49%
	Soda Sanayii		SODA			0,56	5,58	20.08.2019			6,18		3,43	0,00%	0,00%
	Turkcell		TCELL			634,00	12,33	15.10.2019			13,80		8.749,20	2,12%	0,32%
	Türk Hava Yolları		THYAO			1.141,00	14,16	04.12.2019			14,46		16.498,86	4,00%	0,60%
	Tofaş Otomobil Fabrikaları		TOASO			367,00	23,70	13.11.2019			26,86		9.857,62	2,39%	0,36%
	Trakya Cam		TRKCM			0,24	4,13	13.06.2018			3,50		0,84	0,00%	0,00%
	Türk Telekom		TTKOM			1.365,00	6,96	13.11.2019			7,37		10.060,05	2,44%	0,36%
	Türk Traktör		TTRAK			208,00	45,66	13.11.2019			55,40		11.523,20	2,80%	0,42%
	Ülker Bisküvi		ULKER			446,00	18,37	15.10.2019			22,36		9.972,56	2,42%	0,36%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	(%)	(%)
	Yapı ve Kredi Bankası		YKBNK			0,07	1,78	13.11.2018			2,48		0,17	0,00%	0,00%
Toplam						49.904,11							412.102,49		14,95%
GRUP TOPLAMI						49.904,11							412.102,49		14,95%
B.BORÇLANMA															
ARAÇLARI															
B1.ÖZEL SEKTÖR															
BORÇLANMA ARAÇLARI															
FİNANSMAN BONOSU	ATA GMYO	16.10.2020	TRFATAYE2028	4,82%	4,000	90.000,00	100,69	31.10.2019	0		104,08	1	93.667,50	15,32%	3,40%
Toplam						90.000,00							93.667,50		3,40%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	YDA İnşaat	14.02.2020	TRSYDAT22015	2,83%	4,000	70.000,00	100,23	20.12.2017	0		101,98	1	71.383,90	11,68%	2,59%
	Akfen Holding	19.03.2020	TRSAKFH32013	3,88%	4,000	80.000,00	99,57	21.06.2019	0		100,75	1	80.598,40	13,18%	2,92%
	Tüpraş	22.01.2021	TRSTPRS12115	6,32%	4,000	70.000,00	101,44	15.05.2019	0		103,05	1	72.137,10	11,80%	2,62%
	Arçelik	12.02.2021	TRSARCL22117	6,17%	4,000	70.000,00	102,79	15.05.2019	0		101,69	1	71.184,40	11,64%	2,58%
	Migros Ticaret	24.02.2021	TRSMGTI22115	6,84%	4,000	50.000,00	102,47	15.05.2019	0		102,12	1	51.059,00	8,35%	1,85%
	Ereğli Demir ve Çelik	28.05.2021	TRSERGL52117	6,72%	4,000	90.000,00	108,07	27.08.2019	0		101,72	1	91.550,70	14,98%	3,32%
	Aygaz	18.06.2021	TRSAYGZ62110	6,44%	4,000	80.000,00	105,64	29.08.2019	0		99,64	1	79.708,00	13,04%	2,89%
Toplam						510.000,00							517.621,50		18,77%
GRUP TOPLAMI						600.000,00							611.289,00		22,17%
B2.KAMU SEKTÖRÜ															
BORÇLANMA ARAÇLARI															
DEVLET TAHVİLİ	T.C. Hazine Müsteşarlığı	16.09.2020	TRT160920T25	0,00%	0,000	200.000,00	84,58	26.08.2019	0,1131		92,68	1	185.360,00	14,31%	6,72%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	07.10.2020	TRT071020T23	0,00%	0,000	250.000,00	90,70	25.11.2019	0,1127		92,13	1	230.330,00	17,78%	8,35%
Toplam						450.000,00							415.690,00		15,08%
KUPONLU DEVLET TAH.	T.C. Hazine Müsteşarlığı	15.01.2020	TRT150120T16	5,25%	2,000	90.000,00	98,30	25.02.2019			104,85	1	94.360,50	7,28%	3,42%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.02.2021	TRT170221T12	5,35%	2,000	50.000,00	110,27	28.06.2016			103,46	1	51.730,50	3,99%	1,88%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	21.04.2021	TRT210421T14	10,45%	2,000	200.000,00	114,85	23.12.2019			115,54	1	231.086,00	17,84%	8,38%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	22.09.2021	TRT220921T18	4,60%	2,000	50.000,00	100,98	04.10.2016			99,28	1	49.640,00	3,83%	1,80%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.08.2022	TRT170822T15	5,35%	2,000	100.000,00	96,99	13.12.2017			102,31	1	102.311,00	7,90%	3,71%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	11.02.2026	TRT110226T13	5,30%	2,000	50.000,00	107,23	19.10.2016			97,95	1	48.974,00	3,78%	1,78%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	24.02.2027	TRT240227T17	5,50%	2,000	100.000,00	104,61	09.10.2017			98,95	1	98.945,00	7,64%	3,59%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	11.08.2027	TRT110827T16	5,25%	2,000	100.000,00	96,50	12.12.2017			96,74	1	96.739,00	7,47%	3,51%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	08.03.2028	TRT080328T15	6,20%	2,000	100.000,00	84,64	27.06.2018			105,81	1	105.807,00	8,17%	3,84%
Toplam						840.000,00							879.593,00		31,90%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP 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	(%)	(%)
GRUP TOPLAMI						1.290.000,00							1.295.283,00		46,98%
TOPLAM						1.890.000,00							1.906.572,00		69,15%
Ç.TUREV															
ARAÇLAR															
ViOP NAKİT TEMİNAT						286.157,81							286.157,81	65,79%	10,38%
Toplam						286.157,81							286.157,81		10,38%
VIOP SÖZLEŞMESİ															
Uzun Pozisyon			F_XAUTRYM0220			500,00	293,70	27.12.2019			297,63	1	0,00	0,00%	0,00%
Ara Toplam													0,00		0,00%
Toplam													0,00		0,00%
GRUP TOPLAMI						286.157,81							0,00		0,00%
G.DİĞER															
VARLIKLAR															
YATIRIM FONU KATILMA PAYLARI			ANZ			42.700,00	1,19	06.02.2018			2,01	1	85.794,85	56,36%	3,11%
			TLE			26.200,00	2,32	25.09.2018			2,54	1	66.430,44	43,64%	2,41%
Toplam						68.900,00							152.225,29		5,52%
GRUP TOPLAMI						68.900,00							152.225,29		5,52%
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ						2.008.804,11							2.757.057,59		

**ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN
GRUP 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	2.757.057,59		99,73	1.919.607,29	100,00%	98,35%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	2.757.057,61		99,73	1.919.607,32	100,00%	98,35%
B,HAZIR DEĞERLER	6.719,46		0,24	34.066,42	100,00%	1,75%
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	6.719,46	100,00	0,24	34.066,42	100,00%	1,75%
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C,ALACAKLAR	7.944,16		0,29	8.930,04	100,00%	0,46%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	7.944,16	10000,00%	0,29	8.930,04	100,00%	0,46%
f) Peşin Ödenen Giderler	-	-	-	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E,BORÇLAR	-7.242,57	0,00%	-0,26	-10.882,72	-100,00%	-0,56%
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-4.630,14	-6393,00%	-0,17	-3.334,44	-30,64%	-0,17%
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) SPK Kayda Alma Ücreti	-	-	-	-	-	-
h) Pay Geri Alış Borçları	-	-	-	-	-	-
ı) Diğer Borçlar	-2.612,43	-3607,00%	-0,09	-7.548,28	-6936,00%	-0,39%
Fon toplam değeri	2.764.479		100,00	1.951.721,03		100,00%