

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş.
Ata Portföy Dinamik Değişken Emeklilik Yatırım
Fonu

Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy
Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu
İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak
Hazırlanmasına İlişkin Bağımsız Denetçi Raporu

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Ata Portföy Dinamik Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Ata Portföy Dinamik Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan “Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin 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 2022 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Ata Portföy Dinamik Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan “Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2)” hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş.’nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

DENGE BAĞIMSIZ DENETİM SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
MAZARS Üyesi



Aziz Murat Demirtaş
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 28 Nisan 2023

00

31.12.2021 Tarihli
Fiyat Raporu Tablosu Ek 1 (a)

Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı	Vade	ISIN	Menkul	Normal Faiz Oranı	Faiz Ödemem Sayısı	Nominal	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %	
A.PAY	Anadolu Efes		TRAAFEF91A9	AEFES			8.331.0000	21.037435	22.09.2021				29,62		246764,22	0,0455	0,0172	
	AG Anadolu Grubu Holding		TRAYAZI91Q6	AGHOL			3.900.0000	26,693165	25.11.2021				39,32		153348	0,0283	0,0107	
	Akbank		TRAAKBNK91N6	AKBNK			35,764.5000	5,865036	25.11.2021				7,2		257504,4	0,0475	0,0179	
	Alarko Holding		TRAAALRK91Q0	ALARK			19,973.0000	9,561174	25.11.2021				12,4		247,665,20	4,577%	1,72%	
	Alkim Alkali Kimya		TRAAALKM91E0	ALKIM			4280	6,270701	03.04.2020				16,87		10,59	0	0,00%	
	Anatolia Tani ve Biyoteknoloji Ürünleri		TREANGNO02B8	ANGEN			5,600.0000	21,671655	25.11.2021				29,12		163,520,00	3,02%	1,14%	
	Aselesan		TRAAASEL91H2	ASELS			10,140.0000	16,272249	13.10.2021				20,88		211,723,20	0,039	1,47%	
	ATP Ticari Bilgisayar Ağı ve Elektrik Güç Kaynakları		TREATTPO0023	ATATP			6,000.0000	24	02.06.2021				60,25		361,500,00	0,0667	2,51%	
	Aygaz		TRAAVGAZ91E0	AYGAZ			7,067.0000	17,47759	22.09.2021				22,44		158583,48	0,0292	0,011	
	Coca Cola İçecek		TRECOLA00011	CCOLA			2,283.0000	57,090478	22.09.2021				88,55		202159,65	0,0373	0,0341	
	Enerjisa Enerji A.Ş.		TREENSA00014	ENISA			10,712.0000	11,120752	08.07.2021				12,88		137,070,56	2,54%	0,96%	
	Ereğli Demir ve Çelik		TREAERGL91G3	EREGL			13,937.0000	14,649875	13.10.2021				28,16		392,465,92	7,24%	2,73%	
	Türkiye Garanti Bankası		TRAGARAN91N1	GARAN			22,286.0000	9,084582	25.11.2021				11,27		251,163,22	4,63%	1,75%	
	İş Bankası		TRAIISCTR91N2	ISCTR			28,130.0000	5,218888	22.09.2021				7,19		202,254,70	3,73%	1,41%	
	İş GYO		TRAIISGYO91Q3	ISGYO			7310	1,376197	17.05.2016				3,03		2,21	0,00%	0,00%	
	Karel Elektronik		TREKREL00019	KAREL			4470	10,281879	08.07.2021				11,85		5,30	0,00%	0,00%	
	Koç Holding		TRAKOCHOL01Q8	KOCHOL			10,940.0000	18,494534	22.09.2021				28,38		310,477,20	5,72%	2,16%	
	Lego Yazılım		TRALOGOW91L2	LOGEL			3,340.0000	39,796935	22.09.2021				41,62		139,010,80	0,0256	0,97%	
	Migros Ticaret		TREMGTM00012	MGROS			6,261.0000	31,398367	07.10.2021				37,94		237,542,34	0,0438	1,65%	
	Odış Elektrik		TREODAS00014	ODAS			6650	1,303759	04.12.2019				1,34		0,89	0	0,00%	
	Petkim		TRAPETKM91E0	PETKM			2400	6,220833	22.09.2021				7,8		1,07	0	0	
	Sabancı Holding		TRASAHOL91Q5	SAHOL			23,200.0000	12,409827	25.11.2021				13,23		36936	0,0566	0,0213	
	Şişe Cam		TRASISE91Q23	SSE			23,725.9990	6,475032	22.09.2021				13,38		317453,87	5,85%	2,21%	
	Tav Havalimanları		TRATAVH00018	TAHVL			8,813.0000	24,289798	25.11.2021				32,7		288185,1	0,0531	2,00%	
	Tofaş Otomobil Fabrikaları		TRATOA91H3	TOASO			2,500.0000	47,146163	22.09.2021				75,7		189250	0,0349	1,32%	
	Türk Telekom		TRETTLK00013	TTKOM			31,500.0000	9,51486	25.11.2021				9,63		303345	0,0559	0,0211	
	Türk Traktör		TRETTTRK00010	TTTRAK			801.0000	164,719765	08.07.2021				224		179424	0,0331	0,0125	
	Ülper		TRATUP91E08	TURUPS			1,070.0000	108,306876	13.10.2021				154,4		165,208,00	3,05%	1,15%	
	Vestel Beyaz Eşya		TREVEST00017	VESBE			9470	6,087645	22.09.2021				7,88		7,46	0	0,00%	
	Yapı ve Kredi Bankası		TRAYKBNK91N6	YKBNK			1330	2,91	19.02.2021				3,38		0,45	0,00%	0,00%	
	Toplam							286,278.2900								5,423,483.63		37,70%
	GRUP TOPLAMI							286,278.2900								5,423,483.63		37,70%
	B.BORÇLANLAMA																	
	ARAÇLARI																	
B1.ÖZEL SEKTÖR																		
BORÇLANLAMA ARAÇLARI																		
FİNANSMAN BONUSU																		
	Akbank	03.02.2022	TRFAKBK22220	TRFAKBK22220	0	0.000	700,000.0000	97.005	25.11.2021		0		98.577	1	690039	0.1761	0.048	
	Tam Finans Faktoring	03.03.2022	TRFTAMF32227	TRFTAMF32227	0	0.000	400,000.0000	90.013	02.09.2021		0		96.929	1	387716	0.0989	0.0269	
	ATA GMYO	30.03.2022	TRFATAY32223	TRFATAY32223	0.1222	12.000	300,000.0000	100	29.09.2021		0		106.307	1	318921	0.0814	0.0222	
	Zorlu Enerji	18.05.2022	TRFZORN92218	TRFZORN92218	0	0.000	500,000.0000	85.097	19.08.2021		0		91.999	1	459995	0.1174	0.032	
	Qua Granite Haya Yapı ve Ürünleri	06.10.2022	TRFQAGR2214	TRFQAGR2214	0.03	4.000	150,000.0000	100	08.10.2021		0		104.529	1	156793.5	0.04	0.0109	
Toplam							2,050,000.0000								2013464.5	0.1399		
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ																		
	Pegasus	11.02.2022	TRSPGGS22218	TRSPGGS22218	0.03	4.000	500,000.0000	100	11.02.2021		0		102.558	1	512790	0.1308	0.0356	
	Vestel	09.03.2022	TRSVSTL32213	TRSVSTL32213	0.025	4.000	440,000.0000	100	19.02.2021		0		102.102	1	449248.8	0.1146	0.0312	
	Zorlu Enerji	27.04.2022	TRSZORN42220	TRSZORN42220	0.0658	4.000	500,000.0000	100	22.04.2021		0		104.568	1	522840	0.1334	0.0363	
	KORTEKS MENSUCAT SANAYİ VE TİCARET	14.12.2022	TRSKORTA2218	TRSKORTA2218	0	0.000	1,940.000.0000	80.804	02.12.2021		0		84.172	1	420860	0.1074	0.1325	
Toplam							5,900,000.0000								1905738.8	0.1325		
GRUP TOPLAMI							3,990,000.0000								3919203.3	0.2724		
B2.KAMU SEKTÖRÜ																		
BORÇLANLAMA ARAÇLARI																		
KUPONLU DEVLET TAH.																		
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	20.09.2023	TRT200923T18	TRT200923T18	0.086	2.000	500,000.0000	100.0231	20.10.2021				98.68	1	493400	0.3125	0.0343	
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	11.02.2026	TRT110226T13	TRT110226T13	0.053	2.000	50,000.0000	107.231	19.10.2016				70.087	1	35043.5	0.0222	0.0024	
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	24.02.2027	TRT240227T17	TRT240227T17	0.055	2.000	100,000.0000	104.606	09.10.2017				66.198	1	66198	0.0419	0.0046	
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	24.02.2027	TRT240227T17	TRT240227T17	0.055	2.000	200,000.0000	73.6511	10.06.2019				66.198	1	132396	0.0839	0.0092	
Ara Toplam							300,000.0000								198594	0.1258	0.0138	
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	11.08.2027	TRT110827T16	TRT110827T16	0.0525	2.000	100,000.0000	96.502	12.12.2017				62.933	1	62933	0.0399	0.0044	
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	08.03.2028	TRT080328T15	TRT080328T15	0.062	2.000	100,000.0000	84.6385	27.06.2018				68.187	1	68187	0.0432	0.0047	
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	08.03.2028	TRT080328T15	TRT080328T15	0.062	2.000	200,000.0000	77.793405	10.06.2019				68.187	1	136374	0.0864	0.0095	
Ara Toplam							300,000.0000								204561	0.1296	0.0142	
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	13.11.2030	TRT131130T14	TRT131130T14	0.0585	2.000	1,000,000.0000	75.6375	20.10.2021				58.436	1	584360	0.3701	0.0406	
Toplam							2,250,000.0000								1578891.5	0.1097		
GRUP TOPLAMI							2,250,000.0000								1578891.5	0.1097		
TOPLAM							6,240,000.0000								5498094.8	0.3822		
C.KİRA																		
SERTİFİKALARI																		
ÖZEL SEKTÖR-TL																		
	MLP Sağlık Hizmetleri	14.03.2022	TRDYVKS32225	TRDYVKS32225	0	4.000	300,000.0000	100	12.03.2021		0		102.332	1	306996	0.3318	0.0213	
	MLP Sağlık Hizmetleri	25.05.2022	TRDYVKS52215	TRDYVKS52215	0.0536	4.000	600,000.0000	100	24.05.2021		0		103.064	1	618384	0.6682	0.043	
Toplam							900,000.0000								925380		0.0643	
GRUP TOPLAMI							900,000.0000								925380		0.0643	
Ç.TÜREV																		
ARAÇLAR																		
	VIOP NAKİT TEMİNAT						.0000								0	0	0	
	Toplam						.0000								0	0	0	
	VIOP SÖZLEŞMESİ														0	0	0	
	Uzun Pozisyon		F_USDTRY0222				70.0000	12.75	28.12.2021				14.5033	1	0	0	0	
	Uzun Pozisyon		F_KAUTRYM0222				1,000.0000	747.5	28.12.2021				862.5	1	0	0	0	
Ara Toplam															0	0	0	
Toplam															0	0	0	
GRUP TOPLAMI							.0000								0	0	0	
G.DİĞER																		
VARLIKLAR																		
	YATIRIM FONU KATILIMA PAYLARI																	
	AK PORTFÖY AVRUPA YABANCI HİSSE SENEDİ FONU			AFV			6,348,851.0000	0.081299	11.06.2021				0.112346	1	713268.01	0.2808	0.0496	
	Ata Portföy Dördüncü Serbest Fon			ANZ			149,570.0000	1.732157	06.02.2018				4.45237	1	665940.98	0.2622	0.0463	
	İŞ PORT. SİBER GÜV. TEKN. DEĞ. FON			UZ			374,674.0000	1.300933	02.11.2021				1.590286	1	595838.82	0.2346	0.0414	
	İŞ PORTFÖY EMİTİA YABANCI BYT FON SEPETİ FONU			TGE			10,807,000.0000	0.03184	22.03.2021				0.052304	1	568249.33	0.2225	0.0393	
							17,680,095.0000								2540297.14	0.1766		
							17,680,095.0000								2540297.14	0.1766		
Toplam							25,106,373.2900						0		14387255.58			
GRUP TOPLAMI													0					
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ													0					

Fiyat Raporu Tablosu Ek 1 (b)
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

	31.12.2022			31.12.2021		
	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	70,142,885.36		99	14,387,255.58		81.24
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	70,241,385.74		99.14	14,387,254.96		81.24
B. HAZIR DEĞERLER (+)	40,675.63		0.06	2,182,198.58		12.32
a) Kasa	0	0	0	0	0	0
b) Bankalar	40,675.63	100	0.06	2,182,198.58	100	12.32
c) Diğer Hazır Değerler	0	0	0	0	0	0
C. ALACAKLAR (+)	1038930.13		1.47	1195434.4		6.75
a) Takastan Alacaklar T1	1007404.38	96.97	1.42	1190720.92	99.61	6.72
b) Takastan Alacaklar T2	0	0	0	0	0	0
c) Takastan BPP Alacakları	0	0	0	0	0	0
d) Diğer Alacaklar	31525.75	3.03	0.04	4713.48	0.39	0.03
Ç. DİĞER VARLIKLAR (+)	0		0	0		0
D. BORÇLAR (-)	369,483.03		0.52	54,333.61		0.31
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	0	0	0
b) Takasa Borçlar T2	0	0	0	0	0	0
c) Yönetim Ücreti	115,097.39	31.15	0.16	48,009.26	88.36	0.27
d) Ödenecek Vergi	0	0	0	0	0	0
e) İhtiyatlar	0	0	0	0	0	0
f) Krediler	0	0	0	0	0	0
g) Diğer Borçlar	254,385.64	68.85	0.36	6,324.35	11.64	0.04
F. MD Düşüş Karşılığı	0.00		0	0.00		0
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	70,853,008.09		100.00	17,710,554.95		100.00
Kontrol						
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	0.00			0.00		
ViOP NAKİT TEMİNAT						