

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
DİNAMİK DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2018 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.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski unvanıyla “ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
DİNAMİK 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. Sürdürülebilirlik Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu’nun (Eski unvanıyla “Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dinamik Değişken Grup Emeklilik Yatırım Fonu”) (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 2018 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Sürdürülebilirlik Hisse Senedi 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.

Talar Gül, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 30 Nisan 2019

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
DİNAMİK DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Satın Alış	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	Birim	Değerleme	Bugünkü	Günlük	Toplam	Grup	FTD
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	Alış Fiyatı	Fiyatı	Deger	Kur	(%)	(%)	(%)
HS		14.12.2018	AEFES			7,000.00	20.846329			20.6	144,200.00		1.65	1.99	1.75
HS		28.12.2018	AEFES			2,000.00	20.48			20.6	41,200.00		0.47	0.57	0.5
			Ara Toplam :			9,000.00	20.764923				185,400.00		2.12	2.56	2.25
HS		26.12.2018	AKBNK			80,000.00	7.9207			6.86	548,800.00		6.27	7.56	6.66
HS		24.12.2018	AKSA			2,000.00	7.4			7.46	14,920.00		0.17	0.21	0.18
HS		21.12.2018	ANACM			35,000.00	2.6			2.68	93,800.00		1.07	1.29	1.14
HS		21.12.2018	ARCLK			7,000.00	21.440206			15.79	110,530.00		1.26	1.52	1.34
HS		28.12.2018	ARCLK			5,000.00	15.5			15.79	78,950.00		0.9	1.09	0.96
			Ara Toplam :			12,000.00	18.96512				189,480.00		2.16	2.61	2.3
HS		28.12.2018	ASELS			15,000.00	23.587706			24.08	361,200.00		4.13	4.98	4.38
HS		24.12.2018	AYGAZ			2,000.00	11.4			11.33	22,660.00		0.26	0.31	0.27
HS		24.12.2018	CCOLA			2,500.00	30.76			30.88	77,200.00		0.88	1.06	0.94
HS		18.12.2018	EREGL			55,000.10	7.266608			7.22	397,100.72		4.54	5.47	4.82
HS		21.12.2018	PROTO			3,000.00	52.056733			50	150,000.00		1.71	2.07	1.82
HS		26.12.2018	GARAN			80,000.00	9.180488			7.96	636,800.00		7.27	8.77	7.73
HS		24.12.2018	GLYHO			5,000.00	3			2.99	14,950.00		0.17	0.21	0.18
HS		28.12.2018	HALKB			25,000.00	7.026			7.02	175,500.00		2	2.42	2.13
HS		17.12.2018	HEKTS			10,000.00	8.219175			9.27	92,700.00		1.06	1.28	1.12
HS		26.12.2018	ISCTR			40,000.00	6.005			4.53	181,200.00		2.07	2.5	2.2
HS		29.04.2013	ISGSY			0.67	2.514881			2.04	1.37		0	0	0
HS		8.05.2018	ISGYO			0.01	1.25			1.08	0.01		0	0	0
HS		13.05.2015	ISMEN			0.21	1.074766			2.06	0.44		0	0	0
HS		27.12.2018	KCHOL			5,000.00	14.05			14.2	71,000.00		0.81	0.98	0.86
HS		28.12.2018	KCHOL			1,000.00	14.03			14.2	14,200.00		0.16	0.2	0.17
HS		28.12.2018	KCHOL			20,000.00	14.732448			14.2	284,000.00		3.24	3.91	3.45
			Ara Toplam :			26,000.00	14.574191						4.21	5.09	4.48

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
DİNAMİK DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Satın Alış	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Alış	Değerleme	Bugünkü	Günlük	Toplam	Grup	FTD
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Kur	Fiyatı	Fiyatı	Deger	Kur	(%)	(%)	(%)
HS		13.12.2018	KORDS			2,500.00	2,500	9.61	9.78	24,450.00		0.28	0.34	0.3
HS		30.05.2018	KOZAL			2,000.00	2,000	46.204	51.3	102,600.00		1.17	1.41	1.24
HS		21.12.2018	MGROS			3,000.00	3,000	14.673333	14.9	44,700.00		0.51	0.62	0.54
HS		31.12.2018	PETKM			25,000.00	25,000	5.058	5.04	126,000.00		1.44	1.74	1.53
HS		31.12.2018	PGSUS			2,000.00	2,000	23.12	22.92	45,840.00		0.52	0.63	0.56
HS		31.12.2018	SAHOL			36,000.00	36,000	8.677574	7.52	270,720.00		3.09	3.73	3.28
HS		26.04.2017	SASA			0.03	0	1.333333	8.19	0.25		0	0	0
HS		28.12.2018	SISE			30,000.00	30,000	5.153333	5.67	170,100.00		1.94	2.34	2.06
HS		28.12.2018	SODA			35,000.41	35,000	7.354114	7.1	248,502.93		2.84	3.42	3.01
HS		28.12.2018	SODA			5,000.00	5,000	7.09	7.1	35,500.00		0.41	0.49	0.43
			Ara Toplam :			40,000.41	40,000	7.3211		284,002.93		3.25	3.91	3.45
HS		26.12.2018	TAVHL			4,000.00	4,000	20.61625	23.92	95,680.00		1.09	1.32	1.16
HS		14.12.2018	TCELL			55,000.00	55,000	12.629149	12.17	669,350.00		7.64	9.22	8.12
HS		28.12.2018	THYAO			32,000.00	32,000	15.361431	16.11	515,520.00		5.89	7.1	6.25
HS		4.12.2018	TKFEN			15,000.00	15,000	20.724	20.72	310,800.00		3.55	4.28	3.77
HS		28.12.2018	TKFEN			2,000.00	2,000	20.34	20.72	41,440.00		0.47	0.57	0.5
			Ara Toplam :			17,000.00	17,000	20.678824		352,240.00		4.02	4.85	4.27
HS		31.12.2018	TOASO			10,000.00	10,000	16.255	16.9	169,000.00		1.93	2.33	2.05
HS		2.08.2018	TRKCM			0.11	0	17.63	3.03	0.35		0	0	0
HS		17.12.2018	TSKB			50,000.95	50,001	0.730005	0.81	40,500.77		0.46	0.56	0.49
HS		26.12.2018	TTKOM			45,000.00	45,000	4.005297	3.9	175,500.00		2	2.42	2.13
HS		28.12.2018	TTKOM			5,000.00	5,000	3.88	3.9	19,500.00		0.22	0.27	0.24
			Ara Toplam :			50,000.00	50,000	3.992767		195,000.00		2.22	2.69	2.37

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
DİNAMİK DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2018 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

						Faiz	Nominal		Birim						
Menkul		İhraççı	Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/		Alış	Değerleme	Bugünkü	Günlük	Toplam	Grup	FTD
Kıymet	Vade	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Kur	Fiyatı	Fiyatı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HS			26.12.2018	TUPRS	0		3,300.00	50,000	114.105991	116.7	385,110.00		4.4	5.3	4.67
HS			24.12.2018	ULKER	0		5,000.00	3,300	14.94	14.67	73,350.00		0.84	1.01	0.89
HS			24.12.2018	VAKBN	0		40,000.00		3.9	3.9	156,000.00		1.78	2.15	1.89
HS			24.12.2018	VESBE	0		1,000.00		12.08	12.02	12,020.00		0.14	0.17	0.15
HS			24.12.2018	VESTL	0		3,000.00		5.62	5.55	16,650.00		0.19	0.23	0.2
				Grup Toplamı			812,302.50		0	0	7,259,746.84		82.91		88.07
DT	27.09.2023		16.10.2015	TRT270923T11	4.4		239.00	0	93.719665	76.22017	182.17		0	100	0
				Grup Toplamı			239.00		0	0	182.17		0		0
BP	2.01.2019		31.12.2018		25				130,000.00	0	130,178.08		1.49	100	1.58
				Grup Toplamı					0	0	130,178.08		1.49		1.58
OT	44,572.00		12.09.2017	TRSBMKS12230	0		450,000.00		103.6265	109.5035	492,765.70		5.63	46.46	5.98
OT	43,489.00		24.11.2016	TRSRNSH11919	3.81		540,000.00	0	100.295309	105.1731	567,934.58		6.49	53.54	6.89
				Grup Toplamı			990,000.00		0	0	1,060,700.28		12.11		12.87
VBTM-NK			31.12.2018	TRY	0		0		0	0	305,453.78		3.49	100	3.71
				Grup Toplamı			0		0	0	305,453.78		3.49		3.71
VBK	28.02.2019		31.12.2018	F_XU0300219	0		40	1	119.225	120.425	0		0	0	0
				Grup Toplamı			40		0	0	0		0		0
VBU	28.02.2019		31.12.2018	F_USDTRY0219	0		150	1	5.47	5.4585	0		0	0	0
				Grup Toplamı			150		0	0	0		0		0
				Fon Portföy Değeri			8,756,261.15		0	0	8,756,261.15		100		106.22

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
DİNAMİK DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2018 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2018			31 Aralık 2017		
	Tutar	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%	TL	%	%
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	8,756,261	100.00	106.06	11,541,364	100.00	100.21
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	8,756,261	100.00	106.06	11,541,364	100.00	1.02
B,HAZIR DEĞERLER	13,659	100.00	0.17	11,652	100.00	0.10
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	13,659	100.00	0.17	11,652	100.00	0.10
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C,ALACAKLAR	200,820	100.00	0.24	160	100.00	-
a) Takastan Alacaklar T1	200,660	99.92	0.24	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
e) Peşin Ödenen Giderler	160	0.08	-	160	1.00	-
D,DİĞER VARLIKLAR	952	0.13	-	-	-	-
E,BORÇLAR	(727,505)	(100.00)	(8.83)	(249,164)	(100.00)	(0.22)
a) Takasa Borçlar T1	228,110	(31.36)	(2.77)	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-	-	-	7,515	(0.03)	(0.07)
d) Hizmet Komisyonu	5,429	(0.75)	(0.07)	-	-	-
e) SPK Kayda Alma Ücreti	247	(0.03)	-	339	(0.14)	-
f) Ayrılan İhtiyatlar	-	-	-	240,386	(96.48)	(0.21)
g) Diğer Borçlar	493,718	(67.86)	(5.99)	924	(0.37)	(0.00)
Fon toplam değeri	8,243,236		100.00	11,304,013		100.00