

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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 ("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. 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.



Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 15 Nisan 2020

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	İç	Günlük					
Menkul	Vade	Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	İskon.	Birim	Toplam	Günlük	Grup	Toplam	FTD
Kıymet	Tarihi	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Oranı	Değer	Deger	Kur	(%)	(%)	(%)
A.PAY		08.08.2019	AEFES			6.000,00	20,880024		23,08	138.480,00		1,65	1,44	1,53
		13.06.2019	AKBNK			100.000,00	6,621557		8,11	811.000,00		9,68	8,43	8,95
		24.12.2018	AKSA			2.000,00	7,4		13,7	27.400,00		0,33	0,28	0,3
		29.07.2019	ANACM			50.000,00	2,674		4,36	218.000,00		2,6	2,26	2,41
		29.01.2019	ARCLK			15.000,00	18,770096		20,84	312.600,00		3,73	3,25	3,45
		26.07.2019	ASELS			15.000,00	22,222986		20,94	314.100,00		3,75	3,26	3,47
		24.12.2018	AYGAZ			2.000,00	11,4		12,84	25.680,00		0,31	0,27	0,28
		28.10.2019	CCOLA			5.000,00	31,818144		38,7	193.500,00		2,31	2,01	2,14
		11.06.2019	DOHOL			50.000,00	1,1		1,84	92.000,00		1,1	0,96	1,02
		28.05.2019	EREGL			50.000,10	7,261949		9,04	452.000,90		5,39	4,7	4,99
		01.04.2019	FROTO			3.000,00	49,91404		70,85	212.550,00		2,54	2,21	2,35
		13.06.2019	GARAN			75.000,00	9,053372		11,14	835.500,00		9,97	8,68	9,22
		24.12.2018	GLYHO			5.000,00	3		4,87	24.350,00		0,29	0,25	0,27
		28.12.2018	HALKB			25.000,00	7,026		5,91	147.750,00		1,76	1,53	1,63
		06.08.2019	ISCTR			42.500,00	6,004706		6,41	272.425,00		3,25	2,83	3,01
		29.04.2013	ISGSY			0,67	2,514881		3,8	2,55		0	0	0
		08.05.2018	ISGYO			0,01	1,285714		1,76	0,01		0	0	0
		13.05.2015	ISMEN			0,21	1,074766		4,5	0,96		0	0	0
		01.02.2019	KCHOL			20.000,00	15,050193		20,32	406.400,00		4,85	4,22	4,48
		26.07.2019	KORDS			8.000,00	11,428396		13,08	104.640,00		1,25	1,09	1,15
		16.07.2019	MGROS			5.000,00	14,356		24,22	121.100,00		1,45	1,26	1,34
		29.11.2019	OTKAR			600,00	110,064833		159	95.400,00		1,14	0,99	1,05
		10.05.2019	PETKM			64.000,00	3,749531		3,81	243.840,00		2,91	2,53	2,69
		31.12.2018	SAHOL			30.000,00	8,677588		9,54	286.200,00		3,42	2,97	3,16
		26.04.2017	SASA			0,06	1,327586		7,73	0,45		0	0	0
		28.12.2018	SISE			30.000,00	5,153333		5,27	158100		1,89	1,64	1,74
		08.01.2019	SODA			20.000,41	7,322101		6,18	123602,55		1,48	1,28	1,36
		26.12.2018	TAVHL			2.000,00	20,616305		29,18	58360		0,7	0,61	0,64
		14.12.2018	TCELL			37.500,00	12,629149		13,8	517500		6,18	5,38	5,71
		08.01.2019	THYAO			25.000,00	15,360184		14,46	361500		4,31	3,76	3,99
		27.11.2019	TKFEN			15.000,00	19,839417		19,32	289800		3,46	3,01	3,2

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	İç	Günlük			100		
Menkul	Vade	Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	İskon.	Birim	Toplam	Günlük	Grup	Toplam	FTD
Kıymet	Tarihi	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Oranı	Değer	Deger	Kur	(%)	(%)	(%)
		31.12.2018	TOASO			7.500,00	16,255		26,86	201.450,00		2,4	2,09	2,22
		02.08.2018	TRKCM			0,11	17,628319		3,5	0,40		0	0	0
		17.12.2018	TSKB			50.000,95	0,730005		1,21	60.501,15		0,72	0,63	0,67
		02.01.2019	TTKOM			20.000,00	3,992824		7,37	147.400,00		1,76	1,53	1,63
		26.07.2019	TUPRS			3.500,00	119,281778		126,8	443.800,00		5,3	4,61	4,9
		23.12.2019	ULKER			10.000,00	18,81927		22,36	223.600,00		2,67	2,32	2,47
		13.06.2019	VAKBN			50.000,00	3,756		5,51	275.500,00		3,29	2,86	3,04
		24.12.2018	VESBE			1.000,00	12,08		21,6	21.600,00		0,26	0,22	0,24
		24.12.2018	VESTL			3.000,00	5,62		12,62	37.860,00		0,45	0,39	0,42
		10.05.2019	YKBNK			50.000,00	1,978519		2,48	124.000,00		1,48	1,29	1,37
Toplam						897.602,52				8.379.493,97		0	87,05	92,47
GRUP TOP						897.602,52				8.379.493,97		0	87,05	92,47
ÖZEL SEKT	11.01.2022	12.09.2017	SBMKS12230	12,52%	12,000	450.000,00	103,6265	0	109,503	492.763,50		100	5,12	5,44
Toplam						450.000,00				492.763,50		0	5,12	5,44
GRUP TOP						450.000,00				492.763,50		0	5,12	5,44
KUPONLU	27.09.2023	16.10.2015	RT270923T11	4,40%	2,000	239,00	93,719665		94,281	225,33		100	0	0
Toplam						239,00				225,33		0	0	0
GRUP TOP						239,00				225,33		0	0	0
TOPLAM						450.239,00				492.988,83		0	5,12	5,44
VİOP NAKİ						173.234,27				173.234,27		100	1,8	1,91
Toplam						173.234,27				173.234,27		0	1,8	1,91
GRUP TOP						173.234,27				173.234,27		0	1,8	1,91
TERS REPC	02.01.2020	31.12.2019	RT070727T13	11,25%		500.308,22	130,6421	12%	130,6824	500.154,09		86,21	5,2	5,52
Toplam						500.308,22				500.154,09		0	5,2	5,52
BPP	02.01.2020	31.12.2019		10,85%	0	80.047,56	100000	11%	100029,7	80.023,78		13,79	0,83	0,88
Toplam						80.047,56				80.023,78		0	0,83	0,88
GRUP TOP						580.355,78				580.177,87		0	6,03	6,4
FON/ORTAK						1.928.197,31				9.625.894,00				

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
SÜRDÜRÜLEBİLİRLİK HİSSE SENEDİ 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	9.625.894	0,00	106,23	8.756.261	100,00	106,06
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	9.625.894	0,00	106,23	8.756.261	100,00	106,06
B,HAZIR DEĞERLER	4.273	0,00	0,05	13.659	100,00	0,17
a) Kasa	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Bankalar	4.273	100,00	0,05	13.659	100,00	0,17
c) Diğer Hızır Değerler	0	0,00	0,00	-	-	-
C,ALACAKLAR	0	0,00	0,00	200.820	100,00	0,24
a) Takastan Alacaklar T1	0	0,00	0,00	200.660	99,92	0,24
b) Takastan Alacaklar T2	0	0,00	0,00	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0	0,00	0,00	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	0	0,00	0,00	-	-	-
e) Peşin Ödenen Giderler	0	0,00	0,00	160	0,08	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	0,00	0,00	952	0,13	-
E,BORÇLAR	(75.745)	0,00	(0,84)	(727.505)	(100,00)	(8,83)
a) Takasa Borçlar T1	0	0,00	0,00	228.110	(31,36)	(2,77)
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00	0,00	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	-5.660	-7,47	-0,06	-	-	-
d) Hizmet Komisyonu	0	0,00	0,00	5.429	(0,75)	(0,07)
e) SPK Kayda Alma Ücreti	0	0,00	0,00	247	(0,03)	-
f) Ayrılan İhtiyatlar	0	0,00	0,00	-	-	-
g) Diğer Borçlar	-70.084	-92,53	(0,77)	493.718	(67,86)	(5,99)
F. MD Düşüş Karşılığı	-492.765	0,00	(5,44)	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	9.061.657		100,00	8.243.236		100,00