

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

					Faiz	Nominal	İç	Birim		Repo				
Menkul		Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	İskon.	Alış	Değerleme	Teminat	Bugünkü	Günlük	Grup	Toplam
Kıymet	Vade	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Oranı	Fiyatı	Fiyatı	Tutarı	Deger	Kur	(%)	(%)
		29.11.2019	AEFES			199.000,00		23,207383	23,08		4.592.920,00		0,93	0,88
		30.12.2019	AKBNK			5.837.000,70		6,959611	8,11		47.338.075,69		9,58	9,06
		31.12.2019	AKBNK			10.000,00		8,11	8,11		81.100,00		0,02	0,02
Ara Toplam			AKBNK			5.847.000,70					47.419.175,69		9,6	9,07
		22.09.2014	AKENR			0,42		1,452381	1,09		0,46		0	0
		18.12.2019	AKGRT			900.000,00		4,331013	6,09		5.481.000,00		1,11	1,05
		24.12.2019	ANACM			3.755.000,92		2,95615	4,36		16.371.804,01		3,31	3,13
		31.12.2019	ANACM			10.000,00		4,36	4,36		43.600,00		0,01	0,01
Ara Toplam			ANACM			3.765.000,92					16.415.404,01		3,32	3,14
		09.10.2014	ANHYT			0,80		3,967459	6,84		5,47		0	0
		06.12.2019	ARCLK			645.000,00		17,931599	20,84		13.441.800,00		2,72	2,57
		31.12.2019	ARCLK			82,00		20,84	20,84		1.708,88		0	0
		31.12.2019	ARCLK			2.366,00		20,84	20,84		49.307,44		0,01	0,01
		31.12.2019	ARCLK			2.552,00		20,84	20,84		53.183,68		0,01	0,01
Ara Toplam			ARCLK			650.000,00					13.546.000,00		2,74	2,59
		25.12.2019	ASELS			509.000,00		20,203821	20,94		10.658.460,00		2,16	2,04
		15.07.2011	AYEN			0,71		2,295775	3,47		2,46		0	0
		22.02.2018	AYGAZ			0,22		15,9375	12,84		2,88		0	0
		24.12.2019	BIMAS			316.500,00		38,821599	46,66		14.767.890,00		2,99	2,83
		31.12.2019	BIMAS			1.000,00		46,66	46,66		46.660,00		0,01	0,01
Ara Toplam			BIMAS			317.500,00					14.814.550,00		3	2,83
		15.08.2018	BOLUC			0,77		6,520052	4,7		3,63		0	0
		15.06.2007	DGGYO			0,24		1,23	4,53		1,07		0	0
		08.12.2017	DOHOL			0,91		0,90	1,84		1,67		0	0
		07.11.2006	ECZYT			0,67		2,41	10,11		6,74		0	0
		30.12.2019	ENJSA			1.407.000,00		6,14105	7,39		10.397.730,00		2,1	1,99
		28.05.2018	ENKAI			0,47		4,490405	6,42		3,01		0	0
		30.12.2019	EREGL			2.789.000,73		8,224229	9,04		25.212.566,57		5,1	4,82
		31.12.2019	EREGL			5.000,00		9,04	9,04		45.200,00		0,01	0,01
Ara Toplam			EREGL			2.794.000,73					25.257.766,57		5,11	4,83
		25.12.2019	FROTO			24.000,00		68,2	70,85		1.700.400,00		0,34	0,33
		30.12.2019	GARAN			4.460.000,00		8,819625	11,14		49.684.400,00		10,06	9,51
		31.12.2019	GARAN			192,00		11,14	11,14		2.138,88		0	0

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

					Faiz	Nominal	İç	Birim		Repo				
Menkul		Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	İskonto	Alış	Değerleme	Teminat	Bugünkü	Günlük	Grup	Toplam
Kıymet	Vade	Tarihi	Tanımı	Oran	Sayısı	Kontrat Sayısı	Oran	Fiyatı	Fiyatı	Tutarı	Deger	Kur	(%)	(%)
		31.12.2019	GARAN			9.808,00		11,14	11,14		109.261,12		0,02	0,02
Ara Toplam			GARAN			4.470.000,00					49.795.800,00		10,08	9,53
		27.12.2019	HEKTS			1.656.000,00		6,747251	8,02		13.281.120,00		2,69	2,54
		20.12.2017	HURGZ			0,56		63,636364	1,14		0,64		0	0
		30.12.2019	ISCTR			3.878.000,72		5,883992	6,41		24.857.984,59		5,03	4,76
		31.12.2019	ISCTR			10.000,00		6,41	6,41		64.100,00		0,01	0,01
Ara Toplam			ISCTR			3.888.000,72					24.922.084,59		5,05	4,77
		30.05.2018	ISFIN			0,61		0,543657	3,8		2,31		0	0
		08.05.2018	ISGYO			0,81		10,062112	1,76		1,42		0	0
		18.12.2019	KCHOL			387.000,53		17,650569	20,32		7.863.850,71		1,59	1,5
		29.11.2019	KORDS			278.000,00		11,105209	13,08		3.636.240,00		0,74	0,7
		05.12.2019	KOZAA			305.000,00		6,463049	10,03		3.059.150,00		0,62	0,59
		18.12.2019	KOZAL			80.000,66		43,168494	74,05		5.924.049,17		1,2	1,13
		20.12.2019	KRDMD			1.600.000,09		2,57	2,66		4.256.000,23		0,86	0,81
		18.12.2019	MGROS			321.000,00		21,044095	24,22		7.774.620,00		1,57	1,49
		03.04.2019	ODAS			0,63		2,678914	2,1		1,31		0	0
		14.11.2019	PETKM			470.000,99		4,256651	3,81		1.790.703,78		0,36	0,34
		30.12.2019	PGSUS			126.500,00		59,626832	86,4		10.929.600,00		2,21	2,09
		10.08.2011	RYSAS			0,57		1,946903	4,38		2,47		0	0
		24.12.2019	SAHOL			2.429.000,72		9,111714	9,54		23.172.666,90		4,69	4,43
		31.12.2019	SAHOL			5.000,00		9,54	9,54		47.700,00		0,01	0,01
Ara Toplam			SAHOL			2.434.000,72					23.220.366,90		4,7	4,44
		24.12.2019	SISE			3.217.000,89		4,86	5,27		16.953.594,70		3,43	3,24
		31.12.2019	SISE			10.000,00		5,27	5,27		52.700,00		0,01	0,01
Ara Toplam			SISE			3.227.000,89					17.006.294,70		3,44	3,25
		29.04.2013	SNGYO			0,40		1,35	1,16		0,46		0	0
		29.11.2019	SODA			19.000,82		5,796358	6,18		117.425,04		0,02	0,02
		24.12.2019	TAVHL			80.000,00		29,46	29,18		2.334.400,00		0,47	0,45
		30.12.2019	TCELL			2.885.000,81		12,39479	13,8		39.813.011,16		8,06	7,62
		31.12.2019	TCELL			837,00		13,8	13,8		11.550,60		0	0
		31.12.2019	TCELL			4.163,00		13,8	13,8		57.449,40		0,01	0,01
Ara Toplam			TCELL			2.890.000,81					39.882.011,16		8,07	7,63
		30.12.2019	THYAO			2.717.000,52		12,611203	14,46		39.287.827,50		7,95	7,52

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

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

					Faiz	Nominal	İç	Birim		Repo			100	
Menkul		Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	İskonto	Alış	Değerleme	Teminat	Bugünkü	Günlük	Grup	Toplam
Kıymet	Vade	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Oranı	Fiyatı	Fiyatı	Tutarı	Deger	Kur	(%)	(%)
			THYAO			5.000,00		14,46	14,46		72.300,00		0,01	0,01
Ara Toplam			THYAO			2.722.000,52					39.360.127,50		7,97	7,53
			TKFEN			15.500,93		19,37	19,32		299.477,87		0,06	0,06
			TOASO			372.000,67		18,54	26,86		9.991.937,86		2,02	1,91
			TRCAS			0,47		2,53	2,67		1,25		0	0
			TRKCM			0,07		17,15	3,5		0,26		0	0
			TSKB			0,82		105,99	1,21		1,00		0	0
			TTKOM			3.250.000,00		5,71	7,37		23.952.500,00		4,85	4,58
			TTKOM			5.000,00		7,37	7,37		36.850,00		0,01	0,01
Ara Toplam			TTKOM			3.255.000,00					23.989.350,00		4,86	4,59
			TTRAK			211.000,00		37,54	55,4		11.689.400,00		2,37	2,24
			TUPRS			108.000,00		125,68	126,8		13.694.400,00		2,77	2,62
			TUPRS			500,00		126,80	126,8		63.400,00		0,01	0,01
Ara Toplam			TUPRS			108.500,00					13.757.800,00		2,79	2,63
			ULKER			207.000,00		17,60	22,36		4.628.520,00		0,94	0,89
			VAKBN			2.544.000,98		4,71	5,51		14.017.445,40		2,84	2,68
			YATAS			1.141.000,00		5,44	7,34		8.374.940,00		1,7	1,6
			YKBNK			715.000,74		2,27	2,48		1.773.201,83		0,36	0,34
Toplam						49.935.022,53					493.959.361,52		0	94,51
GRUP TOPLAMI						49.935.022,53					493.959.361,52		0	94,51
ViOP NAKİT TEMİNAT						1.727.119,65					1.727.119,65		100	0,33
Toplam						1.727.119,65					1.727.119,65		0	0,33
GRUP TOPLAMI						1.727.119,65					1.727.119,65		0	0,33
TERS REPO - DT	02.01.2020		TRT030523T13	11,3		14.508.978,08	11,96	182,29	182,3495	7.954.225,00	14.504.488,35		53,77	2,78
	02.01.2020		TRT070727T13	11,3		2.001.238,36	11,96	130,64	130,6825	1.530.900,00	2.000.619,08		7,42	0,38
	02.01.2020		TRT120325T12	11,3		4.502.786,30	11,96	85,19	85,21258	5.282.545,00	4.501.392,93		16,69	0,86
	02.01.2020		TRT280628T18	11,3		5.503.405,48	11,96	116,74	116,7748	4.711.380,00	5.501.702,48		20,4	1,05
Toplam						26.516.408,22					26.508.202,84		0	5,07
BPP	02.01.2020			10,8		465.275,18	11,4	100.000,00	100029,6		465.137,57		1,72	0,09
Toplam						465.275,18					465.137,57		0	0,09
GRUP TOPLAMI						26.981.683,40				19.479.050,00	26.973.340,41		0	5,16
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ						76.916.705,93				19.479.050,00	522.659.823,00			

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
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 TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	522.659.823	0,00	100,77	368.263.421	-	99,72
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	522.659.823	0,00	100,77	368.263.421	-	99,72
B,HAZIR DEĞERLER	13.267	0,00	0,00	16.105	100,00	0,00
a) Kasa	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Bankalar	13.267	100,00	0,00	16.105	100,00	0,00
c) Diğer Hazır Değerler	0	0,00	0,00	-	-	-
C,ALACAKLAR	0	0,00	0,00	7.224.743	100,00	0,02
a) Takastan Alacaklar T1	0	0,00	0,00	2.349.603	32,52	0,01
b) Takastan Alacaklar T2	0	0,00	0,00	4.875.140	67,48	0,01
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	-	-	-
h)Diğer Alacaklar	0	0,00	0,00	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	0,00	0,00	-	-	-
E,BORÇLAR	(4.004.642)	-100,00	(0,77)	(6.212.643)	(100,00)	(0,17)
a) Takasa Borçlar T1	-1.707.810	-42,65	(0,33)	1.637.266	(26,35)	(0,44)
b) Takasa Borçlar T2	-838.210	-20,93	-0,16	3.527.402	(56,78)	(0,96)
c) Yönetim Ücreti	-845.410	-21,11	-0,16	-	-	-
d)Hizmet Komisyonu	0	0,00	0,00	657.319	(10,58)	(0,18)
e) SPK Kayda Alma Ücreti	0	0,00	0,00	11.079	(0,18)	0,00
f)Ayrılan İhtiyatlar	0	0,00	0,00	-	-	-
g) Diğer Borçlar	-613.213	-15,31	-0,12	10.101	(0,16)	0,00
h)Pay Gider Karşılığı	0	0,00	0,00	369.477	-0,06	-0,10
Fon toplam değeri	518.668.448		100,00	369.291.624		100,00