

Allianz Yařam ve Emeklilik A.ř.
Ko İřtirak Endeksi Emeklilik Yatırım Fonu

Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teřkil Eden Portföy
Deęeri Tablosu ve Toplam Deęer/Net Varlık Deęeri Tablosunu
İeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak
Hazırlanmasına İliřkin Baęımsız Deneti Raporu

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Koç İştirak Endeksi 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. Koç İştirak Endeksi 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. Koç İştirak Endeksi 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

31.12.2022 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	Alarko Holding		TRAALARK91Q0	ALARK			0.2200	2.604545	11.09.2018				82		18.04	0	0
	Arçelik		TRAARCLK91H5	ARCLK			2,675,000.0000	42.109123	28.12.2022				112.2		300135000	0.0826	0.0763
	Aygaz		TRAAYGAZ91E0	AYGAZ			3,501,000.8050	17.539082	23.12.2022				95.6		334695677	0.0921	0.085
	Ford Otomotiv		TRAOTOSN91H6	FROTO			745,000.0000	196.239565	27.12.2022				524.5		390,752,500.00	10.75%	9.93%
	İş GYO		TRAISGYO91Q3	ISGYO			0.5770	1.259965	26.03.2020				10.64		6.14	0	0.00%
	Koç Holding		TRAKCHOL91Q8	KCHOL			4,950,000.9500	26.736889	08.12.2022				83.7		414,315,079.52	0.114	10.53%
	Otokar		TRAOTKAR91H3	OTKAR			352,300.0000	282.64205	02.11.2022				1038		365687400	0.1006	0.0929
	Şişe Cam		TRASISEW91Q3	SISE			0.0780	7.551282	05.03.2021				42.92		3.35	0	0
	Tat Gıda		TRATATKS91A5	TATGD			6,719,258.0000	10.054226	22.08.2022				36		241,893,288.00	6.66%	6.15%
	Tofaş Otomobil Fabrikaları		TRATOASO91H3	TOASO			2,370,000.0000	53.651861	14.11.2022				165.7		392,709,000.00	10.81%	9.98%
	T.S.K.B.		TRATSKBW91N0	TSKB			0.6000	1.3	19.04.2021				4.37		2.62	0.00%	0.00%
	Türk Traktör		TRETTWK000J0	TTRAK			646,000.0000	162.692381	23.09.2022				660		426,360,000.00	11.73%	10.83%
	Tüpraş		TRATUPRS91E8	TUPRS			780,000.1620	106.372528	09.12.2022				529.9		413,322,085.84	11.37%	10.50%
	Yapı ve Kredi Bankası		TRAYKBNK91N6	YKBNK			30,000,000.0000	4.214474	28.12.2022				11.81		354,300,000.00	9.75%	9.00%
Toplam							52,738,561.3900								3,634,170,060.47		92.34%
GRUP TOPLAMI							52,738,561.3900								3,634,170,060.47		92.34%
Ç.TUREV																	
ARAÇLAR																	
VIOP NAKİT TEMİNAT							7,952,797.3100								7952797.31	1	0.002
Toplam							7,952,797.3100								7,952,797.31		0.20%
GRUP TOPLAMI							7,952,797.3100								7,952,797.31		0.20%
G.DİĞER																	
VARLIKLAR																	
TPP		02.01.2023			0.108	0.000	1,855,645.7400	100000	30.12.2022	0.114			100059.1694	1	1855097	0.0062	0.0005
Toplam		02.01.2023			10.45%	0.000	1,109,952.5200	100000	30.12.2022	11.01%			100057.2516	1	1,109,634.92	0.37%	0.03%
VADELİ MEVDUAT	YKB	02.01.2023		3	16.00%		2,965,598.2600								2,964,731.92		0.08%
Toplam							115,000,000.0000	0.00	30.12.2022				100.09	1	115,100,800.31	38.17%	2.92%
YATIRIM FONU KATILMA PAYLARI	(YLB) YAPI KREDİ PORTFOY PARA PIYASASI FONU			YLB			229,495,179.0000	0.435739	16.11.2022				0.445425	1	102,222,890.11	33.90%	2.60%
	(YVD) Yapı Kredi Portföy İkinci Para Piyasası (TL) Fonu			YVD			74,059,742.0000	1.08	30.11.2022				1.10	1	81,253,757.22	26.95%	2.06%
Toplam							303,554,921.0000								183,476,647.33		4.66%
GRUP TOPLAMI							421,520,519.2600						0		301,542,179.56		7.66%
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ							474,259,080.6500						0		3,935,712,240.02		

31.12.2021 Tarihli
Fiyat Raporu Tablosu Ek 1 (a)

Yatırıma Piyasası Ara	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 Değeri	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %
A.PAY																	
	Akbank		TRAAKBNK91N6	AKBNK			1,000,000.0000	5.29	30.09.2021				7.2		7200000	0.0076	0.007
	Alarko Holding		TRAAARK91Q0	ALARK			.2200	2.604545	11.09.2018				12.4		2.73	0	0
	Arçelik		TRAAARCLK91H5	ARCLK			1,965,357.0000	22.680405	18.11.2021				48.4		95123278.8	0.1004	0.0929
	Aygaz		TRAAAYGAZ91E0	AYGAZ			4,048,813.0000	12.504643	07.10.2021				22.44		90,855,363.72	9.59%	8.87%
	Ereğli Demir ve Çel		TRAEREG191G3	EREGL			500,000.0000	19.149223	12.11.2021				28.16		14,080,000.00	0.0149	1.37%
	Ford Otomotiv		TRAOTOSN91H6	FROTO			414,000.0000	90.824703	22.12.2021				238.1		98,573,400.00	10.40%	9.62%
	Türkiye Garanti Bar		TRAGARAN91N1	GARAN			1,300,000.0000	9.735544	09.11.2021				11.27		14,651,000.00	0.0155	1.43%
	İş Bankası		TRAISCTR91N2	ISCTR			250,000.0000	6.31	12.11.2021				7.19		1,797,500.00	0.0019	0.18%
	İş GYO		TRAISGYO91Q3	ISGYO			.5770	1.259965	26.03.2020				3.03		1.75	0	0
	Koç Holding		TRAKCHOL91Q8	KCHOL			3,400,000.9500	17.463658	22.12.2021				28.38		96492026.96	0.1018	0.0942
	Kardemir (D)		TRAKRDMR91G7	KRDMD			900,000.0000	8.766306	22.12.2021				9.22		8,298,000.00	0.88%	0.81%
	Otokar		TRAOTKAR91H3	OTKAR			196,500.0000	176.971175	09.11.2021				355		69,757,500.00	7.36%	6.81%
	Şişe Cam		TRASISEW91Q3	SISE			.0780	7.551282	05.03.2021				13.38		1.04	0.00%	0.00%
	Tat Gıda		TRATATKS91A5	TATGD			4,000,000.0000	6.538421	12.03.2021				11.96		47,840,000.00	5.05%	4.67%
	Tav Havalimanları		TRETAVH00018	TAVHL			140,000.0000	27.846721	22.11.2021				32.7		4,578,000.00	0.48%	0.45%
	Tofaş Otomobil Fat		TRATOASO91H3	TOASO			1,300,000.0000	25.352117	05.10.2021				75.7		98,410,000.00	10.38%	9.61%
	T.S.K.B.		TRATSKBW91N0	TSKB			.6000	1.3	19.04.2021				1.44		0.86	0.00%	0.00%
	Türk Traktör		TRETRK00010	TTRAK			429,000.0000	115.443116	22.12.2021				224		96,096,000.00	0.1014	9.38%
	Tüpraş		TRATUPRS91E8	TUPRS			715,000.0000	103.09226	22.12.2021				154.4		110,396,000.00	0.1165	10.78%
	Yataş		TRAYATAS91B4	YATAS			50,000.0000	13.890757	17.09.2021				11.12		556,000.00	0.0006	0.05%
	Yapı ve Kredi Bankı		TRAYKBNK91N6	YKBNK			27,500,000.0000	2.579057	08.04.2021				3.38		92950000	0.0981	0.0907
	Toplam						48,108,672.4200								947654075.9		0.9252
	GRUP TOPLAMI						48,108,672.4200								947654075.9		92.52%
Ç.TUREV																	
ARAÇLAR																	
	VIOP NAKİT TEMİNAT						.0000								0	0	0
	Toplam						.0000								0		0
	GRUP TOPLAMI						.0000								0.00		0.00%
G.DİĞER																	
VARLIKLAR																	
	TERS REPO - DT	03.01.2022	TRT050527T17	TRT050527T17	0.1405		1,001,154.7900	96.0578	31.12.2021	0.1508		1041040	96.094749	1	1,000,384.78	0.0131	0.10%
		03.01.2022	TRT050527T17	TRT050527T17	0.1403		20,023,063.0100	96.0582	31.12.2021	0.1505		20,820,705.00	96.095136	1	20,007,684.72	0.2611	1.95%
		03.01.2022	TRT050527T17	TRT050527T17	0.1405		9,010,393.1500	96.058	31.12.2021	0.1508		9,369,335.00	96.095006	1	9,003,463.05	0.1175	0.0088
	Ara Toplam		TRT050527T17	TRT050527T17			30,034,610.9500								30011532.55	0.3916	0.0293
		03.01.2022	TRT110226T13	TRT110226T13	0.1404		20,023,079.4500	68.0455	31.12.2021	0.1506		29392110	68.071636	1	20007690.19	0.2611	0.0195
		03.01.2022	TRT140126T11	TRT140126T11	0.142		8,009,336.9900	245.9507	31.12.2021	0.1525		3252685	246.046301	1	8003111.12	0.1044	0.0078
	Toplam						58,067,027.3900								58022333.86		0.0566
	TPP	03.01.2022			0.11	0.000	906,819.1200	100000	31.12.2021	0.1162			100030.128	1	906272.96	0.0118	0.0009
	Toplam						906,819.1200								906272.96		0.0009
	VADELİ MEVDUA YKB	28.01.2022			42	0.17	17,588,092.2500		0 17.12.2021				100.694284	1	17710203.52	0.2311	0.0173
	Toplam						17,588,092.2500								17710203.52		0.0173
	GRUP TOPLAMI						76,561,938.7600					63875875			76638810.34		0.0748
	FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ						124,670,611.1900					63875875			1024292886		

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	3,943,665,037.33		99.49	1,024,292,886.20		99.49
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	3,943,665,048.10		99.49	1,024,292,886.50		99.49
B. HAZIR DEĞERLER (+)	6,955.05		0	7,026,524.45		0.68
a) Kasa	0	0	0	0	0	0
b) Bankalar	6,955.05	100	0	7,026,524.45	100	0.68
c) Diğer Hazır Değerler	0	0	0	0	0	0
C. ALACAKLAR (+)	31890246.44		0.8	1057185.31		0.1
a) Takastan Alacaklar T1	30787156.76	96.54	0.78	0	0	0
b) Takastan Alacaklar T2	0	0	0	0	0	0
c) Takastan BPP Alacakları	0	0	0	0	0	0
d) Diğer Alacaklar	1103089.68	3.46	0.03	1057185.31	100	0.1
Ç. DİĞER VARLIKLAR (+)	0		0	0		0
D. BORÇLAR (-)	11,516,253.60		0.29	2,852,681.96		0.28
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	0	0	0
b) Takasa Borçlar T2	0	0	0	0	0	0
c) Yönetim Ücreti	5,661,182.83	49.16	0.14	1,689,203.60	59.21	0.16
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	5,855,070.77	50.84	0.15	1,163,478.36	40.79	0.11
F. MD Düşüş Karşılığı	0.00		0	0.00		0
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	3,964,045,985.22		100.00	1,029,523,914.00		99.98
Kontrol						
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	0.00			0.00		
VIOP NAKİT TEMİNAT						