

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GELİR AMAÇLI İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA
ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)**

**31 ARALIK 2017 TARİHİ İTİBARIYLA
PAY FİYATININ HESAPLANMASINA DAYANAK
TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU
İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN
OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GELİR AMAÇLI İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2017 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası (“TL”) olarak gösterilmiştir.)

MK	Vade	Satın Alış Tarihi	Menkul Tanımı	Faiz Oranı	Bil. Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Repo Dönüş Tutarı	Kur	Günlük Kur	Birim Alış Fiyatı	Değerleme Fiyatı	Kapanış Fiyatı	Bugünkü Değer	Grup(%)	Toplam(%)	FTD(%)	Değer Art./Azalış	Repo Tem. Tutarı	VKG
DR	2.01.2018	29.12.2017	TRT120122T17	12,30	13,08	2,00		7.009.435,62			7.000.000,00	91,67	96,14	7.009.435,62	73,68	6,73	6,63	9.435,62	7.646.550,00	4,00
DR	2.01.2018	29.12.2017	TRT210721T11	12,30	13,08	2,00		2.503.369,86			2.500.000,00	164,20	171,65	2.503.369,86	26,32	2,40	2,37	3.369,86	1.524.560,00	4,00
			Grup Toplamı					9.512.805,48			0,00	0,00	0,00	9.512.805,48		9,13	9,00	12.805,48		
EU	2.04.2019	11.12.2017	T020419	0,00	0,00	1,00	3.500.000,00		3,27	4,52	114,98	111,26	111,26	17.583.966,59	18,62	16,87	16,64	-95.696,87		459,00
EU	11.04.2023	15.12.2017	T110423	0,00	0,00	1,00	3.500.000,00		3,85	4,52	109,46	111,45	111,45	17.614.468,80	18,65	16,90	16,67	-81.271,13		1.929,00
EU	12.11.2021	28.11.2017	T121121	0,00	0,00	1,00	3.762.000,00		3,71	4,52	108,19	110,10	110,10	18.702.264,98	19,80	17,95	17,70	-92.205,47		1.414,00
EU	14.06.2025	22.12.2017	T140625	0,00	0,00	1,00	2.100.000,00		4,23	4,52	100,33	103,36	103,36	9.801.448,16	10,38	9,41	9,27	-48.049,74		2.724,00
EU	17.06.2019	2.06.2017	T170619	0,00	0,00	1,00	900.000,00		3,98	4,52	105,38	104,41	104,41	4.243.312,43	4,49	4,07	4,01	-28.756,73		535,00
EU	18.05.2020	11.09.2017	T180520	0,00	0,00	1,00	5.200.000,00		3,56	4,52	111,06	112,89	112,89	26.507.836,36	28,06	25,44	25,08	-164.546,76		871,00
			Grup Toplamı				18.962.000,00				0,00	0,00	0,00	94.453.297,32		90,64	89,37	-510.526,70		
BP	2.01.2018	29.12.2017		14,95	16,11			240.393,21			240.000,00	0,00	0,00	240.393,21	100,00	0,23	0,23	393,21	0,00	4,00
			Grup Toplamı					240.393,21			0,00	0,00	0,00	240.393,21		0,23	0,23	393,21		
			Fon Portföy Değeri				104.206.496				0,00	0,00	0,00	104.206.496		100,00	98,60	-497.328,01		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GELİR AMAÇLI İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2016 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası (“TL”) olarak gösterilmiştir.)

MK	Vade	Satın Alış Tarihi	Menkul Tanımı	Faiz Oranı	Bil. Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Repo Dönüş Tutarı	Kur	Günlük Kur	Birim Alış Fiyatı	Değerleme Fiyatı	Kapanış Fiyatı	Bugünkü Değer	Grup(%)	Toplam(%)	FTD(%)	Değer Art./Azalış	Repo Tem. Tutarı	VKG
DR	02.01.2017	42.734,00	TRT020823T11	8,02	8,35	2		1.500.989			1.500.000,00	125,122541	132,646133	1.500.989	30	2,52	2,34	989	1.199.615	3
DR	02.01.2017	42.734,00	TRT020823T11	8,02	8,35	2		3.502.307			3.500.000,00	125,12	132,646133	3.502.307	70	5,88	5,45	2.307	2.799.095	3
			Grup Toplamı					5.003.296			0	0,00	0	5.003.296		8,40	7,79	3.296		
EU	02.04.2019	42.635,00	T020419	0	0	1	4.000.000		2,899523	3,7099	116,078	113,7639	113,764	16.882.123	32,67	28,36	26,28	81.748		823
EU	11.04.2023	42.643,00	T110423	0	0	1	1.200.000		3,267226	3,7099	108,1195	106,468	106,468	4.739.828	9,17	7,96	7,38	26.736		2293
EU	12.11.2021	42.390,00	T121121	0	0	1	1.962.000		3,010396	3,7099	103,7152	106,0835	106,0835	7.721.631	14,94	12,97	12,02	51.493		1778
EU	16.02.2017	42.493,00	T160217	0	0	1	3.700.000		2,993095	3,7099	106,6707	105,5594	105,5595	14.489.761	28,04	24,34	22,56	64.200		48
EU	18.05.2020	42.375,00	T180520	0	0	1	1.900.000		2,670088	3,7099	109,074	111,297	111,297	7.845.114	15,18	13,18	12,21	38.888		1235
			Grup Toplamı				12.762.000				0	0	0	51.678.457		86,81	80,45	263.064		
BP	02.01.2017	42.734,00		9,6	10,07			2.847.245			2.845.000,00	0,00	0	2.847.245	100	4,78	4,43	2.245	0	3
			Grup Toplamı					2.847.245			0	0,00	0	2.847.245		4,78	4,43	2.245		
			Fon Portföy Değeri				59.528.998				0	0,00	0	59.528.998		100,00	92,68	268.605		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GELİR AMAÇLI İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU”)

31 ARALIK 2017 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası (“TL”) olarak gösterilmiştir.)

	31 Aralık 2017			31 Aralık 2016		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	104.206.496	100,00%	98,6%	59.528.998	100,00%	92,68%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	100.206.496	100,00%	98,6%	59.528.998	100,00%	92,68%
B. HAZIR DEĞERLER	1.888.994	100,00%	1,79%	4.870.513	100,00%	8,18%
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	1.888.994	100,00%	1,79%	4.870.513	100,00%	8,18%
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	7.098	100,00%	0,01%	14.346	100,00%	0,02%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	6.977	98,29%	0,01%	14.346	100,00%	0,02%
e) Peşin Ödenen Giderler	121	1,71%	-	-	-	-
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E. BORÇLAR	414.261	(100,00)%	(0,39)%	180.763	(100,00)%	(0,30)%
a) Takasa Borçlar T1	237.889	(57,42)%	(0,23)%	71.826	(39,73)%	(0,12)%
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	169.295	(40,87)%	(0,16)%	102.518	(56,71)%	(0,17)%
d) Hizmet Komisyonu	-	-	-	-	-	-
e) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
f) Pay Geri Alış Borçlar	-	-	-	-	-	-
g) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	7.077	(1,71)%	(0,00)%	6.419	(3,55)%	(0,01)%
Fon toplam değeri	105.688.327		100,00	64.233.094		100,00

.....