

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI
KAMU 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.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI KAMU 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	Birim Alış Fiyatı	Değerleme Fiyatı	Kapanış Fiyatı	Bugünkü Değer	Grup(%)	Toplam(%)	FTD(%)	Değer Art./Azalış	Repo Tem. Tutarı	VKG
DT	1.04.2020	14.04.2010	TRT010420T19	2,00	1,84	2,00	80.000,00		0,00	98	190	189,62	152.112	0,50	0,34	0,34	357		824
DT	2.03.2022	14.12.2017	TRT020322T17	0,00		2,00	800.000,00		1,00	103	100	100,11	801.885	2,64	1,81	1,82	10.609		1.524
DT	5.02.2020	22.05.2015	TRT050220T17	0,00	0,00	2,00	2.100.000,00		1,00	97	93	92,83	1.952.187	6,42	4,42	4,42	6.563		768
DT	8.03.2023	28.04.2015	TRT080323T10	0,00	0,00	2,00	2.100.312,00		1,00	94	84	84,08	1.768.133	5,82	4,00	4,00	24.045		1.895
DT	8.07.2020	1.03.2016	TRT080720T19	0,00	0,00	2,00	2.500.000,00		1,00	100	98	97,50	2.440.743	8,03	5,52	5,53	23.746		922
DT	10.07.2019	10.10.2016	TRT100719T18	0,00	0,00	2,00	1.757.443,00		1,00	104	98	97,86	1.722.250	5,67	3,90	3,90	4.235		558
DT	11.02.2026	24.11.2017	TRT110226T13	0,00	0,00	2,00	2.400.000,00		1,00	104	99	99,14	2.382.339	7,84	5,39	5,39	35.714		2.966
DT	11.07.2018	10.11.2017	TRT110718T18	13,33	13,62	2,00	100.000,00			100	102	101,61	101.755	0,33	0,23	0,23	166		194
DT	11.08.2027	26.10.2017	TRT110827T16	0,00	0,00	2,00	300.000,00		1,00	98	99	98,71	296.498	0,98	0,67	0,67	4.300		3.512
DT	12.01.2022	20.02.2015	TRT120122T17	0,00	0,00	2,00	1.800.000,00		1,00	111	96	96,14	1.732.791	5,70	3,92	3,92	21.719		1.475
DT	12.03.2025	20.12.2017	TRT120325T12	0,00	0,00	2,00	400.000,00		1,00	89	85	85,28	341.535	1,12	0,77	0,77	5.326		2.630
DT	14.02.2018	18.04.2016	TRT140218T10	0,00	0,00	2,00	100.000,00		1,00	93	102	101,54	101.674	0,33	0,23	0,23	172		47
DT	14.09.2022	20.10.2016	TRT140922T17	0,00	0,00	2,00	1.000.000,00		1,00	95	90	90,38	904.928	2,98	2,05	2,05	10.510		1.720
DT	14.11.2018	29.01.2015	TRT141118T19	0,00	0,00	2,00	1.000.000,00		1,00	99	97	97,35	974.855	3,21	2,21	2,21	1.233		320
DT	15.01.2020	26.11.2015	TRT150120T16	0,00	0,00	2,00	2.200.000,00		1,00	108	101	100,42	2.212.370	7,28	5,01	5,01	1.380		747
DT	15.05.2019	13.09.2017	TRT150519T15	11,30	10,91	2,00	500.000,00			103	99	98,78	494.581	1,63	1,12	1,12	1.131		502
DT	17.02.2021	12.10.2016	TRT170221T12	0,00	0,00	2,00	2.700.000,00		1,00	103	99	98,97	2.675.872	8,81	6,05	6,06	20.076		1.146
DT	17.08.2022	24.08.2017	TRT170822T15	10,63	8,90	2,00	100.000,00			100	99	99,15	99.274	0,33	0,22	0,22	1.119		1.692
DT	20.03.2024	19.10.2016	TRT200324T13	0,00	0,00	2,00	700.000,00		1,00	108	98	97,53	683.541	2,25	1,55	1,55	8.559		2.273
DT	20.06.2018	13.11.2017	TRT200618T18	0,00	0,00	2,00	1.000.000,00		1,00	100	98	97,90	980.394	3,23	2,22	2,22	1.718		173
DT	22.09.2021	26.10.2016	TRT220921T18	9,37	8,01	2,00	400.000,00			100	93	93,33	373.807	1,23	0,85	0,85	4.410		1.363
DT	24.02.2027	14.12.2017	TRT240227T17	0,00	0,00	2,00	3.280.274,00		1,00	105	101	100,89	3.313.358	10,90	7,50	7,50	53.981		3.344
DT	24.07.2024	23.08.2017	TRT240724T15	0,00	0,00	2,00	1.400.000,00		1,00	97	93	92,89	1.302.070	4,28	2,95	2,95	16.074		2.399
DT	27.03.2019	26.01.2015	TRT270319T13	0,00	0,00	2,00	700.000,00		1,00	110	100	99,39	696.730	2,29	1,58	1,58	981		453
DT	27.09.2023	20.02.2015	TRT270923T11	0,00	0,00	2,00	2.100.000,00		1,00	106	90	89,59	1.883.773	6,20	4,26	4,26	18.018		2.098
			Grup Toplamı				31.518.029,00			-	-	0,00	30.389.455		68,75	68,75	276.142		
DR	2.01.2018	29.12.2017	TRT010420T19	10,00	10,51	2,00		180.197,26		180.000	182	189,62	180.197	26,47	0,41	0,41	197	99.210,00	4
DR	2.01.2018	29.12.2017	TRT261022T10	12,30	13,08	2,00		500.673,97		500.000	142	150,40	500.674	73,53	1,13	1,13	674	351.385,00	4
			Grup Toplamı					680.871,23		-	-	0,00	680.871		1,54	1,54	871		
MV	8.01.2018	7.12.2017	FNBANK180108_0248	14,40	15,38		966.662,85					0,00	976.567	11,95	2,21	2,21	1.530	966.662,85	10
MV	22.01.2018	18.12.2017	TEBANK180122_0168	15,15	16,23		1.894.741,19					0,00	1.906.489	23,32	4,31	4,32	3.140	1.894.741,19	24
MV	15.01.2018	12.12.2017	TIB180115_0286	14,75	15,78		1.800.000,00					0,00	1.815.235	22,21	4,11	4,11	2.912	1.800.000,00	17
MV	22.01.2018	18.12.2017	TIB180122_0286	14,99	16,05		151.956,16					0,00	152.888	1,87	0,35	0,35	249	151.956,16	24
MV	15.01.2018	12.12.2017	VKBANK180115_0136	15,00	16,06		404.990,68					0,00	408.477	5,00	0,92	0,92	666	404.990,68	17
MV	23.01.2018	19.12.2017	VKBANK180123_0136	15,10	16,17		769.257,31					0,00	773.693	9,47	1,75	1,75	1.270	769.257,31	25
MV	30.01.2018	26.12.2017	VKBANK180130_0136	15,20	16,29		708.591,78					0,00	710.645	8,69	1,61	1,61	1.174	708.591,78	32
MV	9.01.2018	11.12.2017	YKBANK180109_0236	14,95	16,02		1.417.404,11					0,00	1.430.159	17,50	3,24	3,24	2.327	1.417.404,11	11
			Grup Toplamı				8.113.604,08			-	-	0,00	8.174.153		18,49	18,50	13.269		
OT	6.01.2020	6.04.2017	TRSAKFH12015	0,00	0,00	4,00	670.000,00		1,00	101	105	105,22	706.114	17,42	1,60	1,60	2.597		738
OT	19.03.2020	4.07.2017	TRSAKFH32013	15,03	13,44	4,00	100.000,00				102	102,08	102.255	2,52	0,23	0,23	350		811
OT	1.02.2019	13.10.2017	TRSCLEKE21918	0,00	0,00	4,00	350.000,00		1,00	101	103	102,57	359.651	8,87	0,81	0,81	646		399
OT	26.07.2022	1.08.2017	TRSENSA72211	0,00	0,00	2,00	600.000,00			100	106	105,79	636.632	15,71	1,44	1,44	1.892		1.670
OT	8.03.2018	10.10.2017	TRSKTMR31812	16,15	16,92	4,00	100.000,00			102	101	101,14	101.334	2,50	0,23	0,23	196		69
OT	13.02.2019	17.02.2017	TRSNLOG21912	0,00	0,00	4,00	400.000,00			100	102	102,06	409.052	10,09	0,93	0,93	794		411
OT	11.10.2019	13.10.2017	TRSSRTNE1912	0,00	0,00	4,00	100.000,00			100	103	103,23	103.402	2,55	0,23	0,23	171		651
OT	22.10.2027	20.10.2017	TRSTHALE2716	0,00	0,00	12,00	100.000,00			100	101	100,85	101.022	2,49	0,23	0,23	175		3.584
OT	27.07.2027	8.08.2017	TRSTISB72712	0,00	0,00	4,00	1.100.000,00			100	103	102,70	1.131.517	27,91	2,56	2,56	1.862		3.497
OT	6.09.2027	18.09.2017	TRSVKFB92719	55,83	20,77	4,00	400.000,00			100	101	100,48	402.591	9,93	0,91	0,91	684		3.538
			Grup Toplamı				3.920.000,00			-	-	0,00	4.053.570		9,17	9,18	9.367		
OITU	21.02.2018	25.02.2015	TRSRSGY21818	10,88	9,88	4,00	300.000,00			100	102	101,78	305.841	100,00	0,69	0,69	499		54
			Grup Toplamı				300.000,00			-	-	0,00	305.841		0,69	0,69	499		
FB	7.05.2018	6.12.2017	TRFAFK51816	0,00	0,00		400.000,00			94	95	95,29	381.718	100,00	0,86	0,86	571		129
			Grup Toplamı				400.000,00			-	-	0,00	381.718		0,86	0,86	571		
YHS		19.07.2017	ISZ	0,00			200.000,00		1,00	1	1	0,00	214.227	100,00	0,48	0,48	8		
			Grup Toplamı				200.000,00			-	-	0,00	214.227		0,48	0,48	8		
			Fon Portföy Değeri				44.199.835,19			-	-	0,00	44.199.835		100,00	100,06	300.727		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI KAMU 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 0,0001	Birim Alış Fiyatı	Değerleme Fiyatı	Kapanış Fiyatı	Bugünkü Değer	Grup(%)	Toplam(%)	FTD(%)	Değer Art./Azalış	Repo Tem. Tutarı	VKG
DT	01.04.2020	40.282,00	TRT010420T19	2	1,84	2	80.000			98	172	172,045648	137.815	0,39	0,3	0,3	621		1188
DT	05.02.2020	42.146,00	TRT050220T17	0	0	2	2.100.000		1	97	94	94,120813	1.978.249	5,56	4,34	4,35	2.219		1132
DT	08.03.2017	42.618,00	TRT080317T18	0	0	2	2.400.000		1	104	103	102,925681	2.471.871	6,95	5,43	5,43	1.365		68
DT	08.03.2023	42.122,00	TRT080323T10	0	0	2	2.100.312		1	94	85	84,536088	1.777.100	4,99	3,9	3,9	917		2259
DT	08.07.2020	42.430,00	TRT080720T19	0	0	2	2.500.000		1	100	101	100,58211	2.516.718	7,07	5,52	5,53	3.564		1286
DT	10.07.2019	42.653,00	TRT100719T18	0	0	2	2.657.443		1	104	100	99,76678	2.653.467	7,46	5,82	5,83	2.687		922
DT	11.02.2026	42.723,00	TRT110226T13	0	0	2	3.100.000		1	105	101	100,907473	3.130.916	8,8	6,87	6,88	6.200		3330
DT	12.01.2022	42.055,00	TRT120122T17	0	0	2	1.800.000		1	111	99	98,619121	1.776.709	4,99	3,9	3,9	3.132		1839
DT	12.03.2025	42.639,00	TRT120325T12	0	0	2	300.000		1	91	86	85,606802	257.050	0,72	0,56	0,56	-27		2994
DT	14.02.2018	42.478,00	TRT140218T10	0	0	2	1.200.000		1	93	99	98,737538	1.185.778	3,33	2,6	2,6	-909		411
DT	14.09.2022	42.663,00	TRT140922T17	0	0	2	1.000.000		1	95	92	91,758165	918.394	2,58	2,02	2,02	755		2084
DT	14.11.2018	42.033,00	TRT141118T19	0	0	2	2.200.000		1	99	98	98,363736	2.165.812	6,09	4,75	4,76	1.739		684
DT	15.01.2020	42.334,00	TRT150120T16	0	0	2	2.300.000		1	108	105	104,946923	2.415.797	6,79	5,3	5,31	3.043		1111
DT	17.02.2021	42.655,00	TRT170221T12	0	0	2	2.900.000		1	103	103	103,334637	2.999.309	8,43	6,58	6,59	-2.628		1510
DT	17.05.2017	42.621,00	TRT170517T15	0	0		600.000		1	94	97	96,943	582.051	1,64	1,28	1,28	247		138
DT	20.03.2024	42.662,00	TRT200324T13	0	0	2	700.000		1	108	99	99,257143	695.418	1,95	1,53	1,53	962		2637
DT	20.06.2018	41.746,00	TRT200618T18	0	0	2	1.000.000		1	98	98	97,70622	977.861	2,75	2,15	2,15	1.789		537
DT	22.09.2021	42.669,00	TRT220921T18	9,37	8,01	2	1.500.000			100	96	96,124549	1.443.131	4,05	3,17	3,17	996		1727
DT	24.07.2024	42.719,00	TRT240724T15	0	0	2	2.100.000		1	98	93	93,144066	1.957.766	5,5	4,30	4,3	-1.365		2763
DT	27.03.2019	42.030,00	TRT270319T13	0	0	2	1.500.000		1	110	102	102,270143	1.535.356	4,31	3,37	3,37	-2.822		817
DT	27.09.2023	42.055,00	TRT270923T11	0	0	2	2.200.000		1	106	92	91,455121	2.013.800	5,66	4,42	4,42	2.845		2462
			Grup Toplamı				36.237.755			0	0	0	35.590.368		78,12	78,17	25.331		
DR	02.01.2017	42.734,00	TRT020823T11	7,51	7,8	2		89.055		89.000	125	132,646133	89.055	3,7	0,2	0,2	55	71.175	3
DR	02.01.2017	42.734,00	TRT020823T11	7,51	7,8	2		316.195		316.000	125	132,646133	316.195	13,14	0,69	0,69	195	252.710	3
DR	02.01.2017	42.734,00	TRT140126T11	8,06	8,39	2		2.001.325		2.000.000	100	0	2.001.325	83,16	4,39	4,4	1.325	2.006.405	3
			Grup Toplamı					2.406.575		0	0	0	2.406.575		5,28	5,29	1.575		
MV	19.01.2017	42.719,00	FBNBK170119_0248	11,55	12,17		1.327.117	1.341.795		0	0	0	1.334.656	23,31	2,93	2,93	1.260	1.327.117	20
MV	05.01.2017	42.705,00	TEBNK170105_0230	10,7	11,23		1.652.431	1.669.345		0	0	0	1.667.892	29,13	3,66	3,66	1.456	1.652.431	6
MV	12.01.2017	42.711,00	VKBK170112_0136	10,7	11,23		1.341.902	1.356.037		0	0	0	1.352.103	23,61	2,97	2,97	1.181	1.341.902	13
MV	19.01.2017	42.719,00	YKBK170119_0236	11,4	12,01		328.618	332.210		0	0	0	330.461	5,77	0,73	0,73	308	328.618	20
MV	25.01.2017	42.725,00	YKBK170125_0236	11,4	12,01		1.036.719	1.048.052		0	0	0	1.040.591	18,17	2,28	2,29	969	1.036.719	26
			Grup Toplamı				5.686.787	5.747.439		0	0	0	5.725.703		12,57	12,58	5.173		
OT	09.01.2017	41.652,00	TRSAKFH1710	13,01	11,61	4	400.000		1	100	103	102,563516	410.633	80	0,9	0,9	544		10
OT	10.10.2017	42.290,00	TRSRNSHE1718	52	42,87	4	100.000			100	103	102,553254	102.650	20	0,23	0,23	97		284
			Grup Toplamı				500.000			0	0	0	513.283		1,13	1,13	640		
OTTU	27.01.2017	42.034,00	TRSLKE11711	11,31	10,74	4	300.000			100	102	102,20382	306.913	23,22	0,67	0,67	301		28
OTTU	21.03.2017	42.087,00	TRSNLOG31713	12,89	12,16	4	400.000			100	101	100,972061	404.297	30,59	0,89	0,89	409		81
OTTU	01.02.2017	42.037,00	TRSNTHL21711	10,91	10,37	12	300.000			100	101	101,013303	303.371	22,95	0,67	0,67	360		33
OTTU	21.02.2018	42.060,00	TRSRSGY21818	10,88	9,88	4	300.000			100	102	102,313297	307.238	23,24	0,67	0,67	605		418
			Grup Toplamı				1.300.000			0	0	0	1.321.819		2,9	2,9	1.675		
			Fon Portföy Değeri				45.557.749			0	0	0	45.557.748		100	100,07	34.395		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI KAMU 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	44.199.835	100,00%	100,06%	45.557.748	100,00%	100,07%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	44.199.835	100,00%	100,06%	45.557.748	100,00%	100,07%
B. HAZIR DEĞERLER	19.100	100,00%	0,04%	12.587	100,00%	0,03%
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	19.100	100,00%	0,04%	12.587	100,00%	0,03%
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	118	100,00%	-	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
e)Peşin Ödenen Giderler	118	100,00%	-	-	-	-
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E. BORÇLAR	44.381	100,00%	(0,10)%	43.555	(100,00)%	(0,10)%
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	37.687	(84,92)%	(0,09)%	39.302	(90,24)%	(0,09)%
c) Hizmet Komisyonu	-	-	-	-	-	-
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) SPK Kayda Alma Ücreti	1.325	(2,99)%	-	1.366	(3,14)%	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	5.369	(12,10)%	(0,01)%	2.887	(6,63)%	(0,01)%
Fon toplam değeri	44.174.672		100,00%	45.526.780		100,00%