

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP
EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI 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.
KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI 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		12,30	13,08	2,00		500.674			500.000	142,49	150,40	500.674	100,00	4,27	4,13	674	351.385	4
			Grup Toplamı					500.674			-	0,00	0,00	500.674				674		
EU	5.02.2025	3.03.2017	T050225	0,00	0,00	2,00	125.000		3,08	3,77	116	118,48	118,48	558.623	4,98	4,76	4,61	3.959		2.595
EU	5.03.2038	8.10.2014	T050338	0,00	0,00	2,00	80.000		2,18	3,77	117	119,11	119,11	359.405	3,20	3,06	2,97	1.748		7.371
EU	5.06.2020	29.07.2015	T050620	0,00	0,00	2,00	300.000		2,42	3,77	118	108,59	108,59	1.228.772	10,95	10,48	10,14	10.936		889
EU	7.11.2019	28.01.2016	T071119	0,00	0,00	2,00	150.000		3,00	3,77	115	108,62	108,62	614.575	5,47	5,24	5,07	5.799		678
EU	9.10.2026	10.11.2016	T091026	0,00	0,00	2,00	200.000		3,18	3,77	99	99,97	99,97	754.116	6,72	6,43	6,22	6.398		3.206
EU	11.03.2019	22.05.2017	T110319	0,00	0,00	2,00	110.000		3,62	3,77	108	106,75	106,75	442.897	3,95	3,78	3,66	4.236		437
EU	11.05.2047	14.12.2017	T110547	0,00	0,00	2,00	100.000		3,85	3,77	98	98,55	98,55	371.721	3,31	3,17	3,07	925		10.725
EU	14.01.2041	5.01.2015	T140141	0,00	0,00	2,00	200.000		2,35	3,77	118	104,14	104,14	785.592	7,00	6,70	6,48	5.355		8.417
EU	14.02.2034	27.01.2012	T140234	0,00	0,00	2,00	100.000		1,85	3,77	122	126,76	126,76	478.134	4,26	4,08	3,95	2.796		5.891
EU	15.01.2030	27.05.2011	T150130	5,94	4,08	2,00	50.000		1,60	3,77	173	163,09	163,09	307.578	2,74	2,62	2,54	2.084		4.400
EU	16.04.2043	10.11.2016	T160443	0,00	0,00	2,00	130.000		3,05	3,77	88	89,15	89,15	437.127	3,89	3,73	3,61	1.453		9.239
EU	17.02.2045	28.12.2017	T170245	0,00	0,00	2,00	180.000		3,71	3,77	112	110,74	110,74	751.837	6,70	6,41	6,21	3.250		9.912
EU	17.03.2036	3.12.2015	T170336	0,00	0,00	2,00	130.000		2,68	3,77	113	113,76	113,76	557.794	4,97	4,76	4,60	3.715		6.653
EU	22.03.2024	19.06.2017	T220324	0,00	0,00	2,00	170.000		3,52	3,77	109	107,69	107,69	690.530	6,15	5,89	5,70	5.886		2.275
EU	23.03.2023	6.04.2016	T230323	0,00	0,00	2,00	20.000		2,83	3,77	95	95,94	95,94	72.374	0,64	0,62	0,60	581		1.910
EU	25.03.2027	30.10.2017	T250327	0,00	0,00	2,00	40.000		3,82	3,77	106	108,29	108,29	163.384	1,46	1,39	1,35	1.130		3.373
EU	30.03.2021	29.11.2017	T300321	0,00	0,00	2,00	470.000		3,47	3,77	108	106,89	106,89	1.894.921	16,88	16,16	15,64	16.951		1.187
EU	30.05.2022	24.05.2017	T300522	0,00	0,00	2,00	200.000		3,57	3,77	100	100,39	100,39	757.317	6,75	6,46	6,25	6.932		1.613
			Grup Toplamı				2.755.000				-	0,00	0,00	11.727.371		95,73	92,66	84.134		
			Fon Portföy Değeri				11.727.371				-	0,00	0,00	11.727.371		100,00	96,79	83.460		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI 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	1/2/2017	12/30/2016	TRT020823T11	7,51	7,8	2		17.010			17.000	125,077132	132,646133	17.010	2,43	0,19	0,18	10	13.600	3
DR	1/2/2017	12/30/2016	TRT020823T11	7,51	7,8	2		183.113			183.000	125,119891	132,646133	183.113	26,14	2,1	1,94	113	146.350	3
DR	1/2/2017	12/30/2016	TRT140126T11	8,06	8,39	2		500.331			500.000	99,746061	0	500.331	71,43	5,73	5,3	331	501.605	3
			Grup Toplamı					700.455			-	0	0	700.455		8,03	7,43	455		
EU	4/3/2018	9/26/2016	T030418	0	0	2	50.000		2,576319	3,5192	113	106,2015	106,2015	186,872	2,41	2,14	1,98	(545)		459
EU	2/5/2025	9/30/2016	T050225	0	0	2	175.000		2,783591	3,5192	118	112,8259	112,826	694,850	8,97	7,96	7,37	(1.462)		2959
EU	3/5/2038	10/8/2014	T050338	0	0	2	80.000		2,176751	3,5192	117	109,296	109,296	307,708	3,97	3,53	3,26	(452)		7735
EU	6/5/2020	7/29/2015	T050620	0	0	2	300.000		2,420824	3,5192	118	108,0524	108,0525	1.140,775	14,73	13,08	12,09	(3.035)		1253
EU	11/7/2019	1/28/2016	T071119	0	0	2	150.000		3,0032	3,5192	115	110,051	110,051	580,937	7,5	6,66	6,16	(2.215)		1042
EU	10/9/2026	11/10/2016	T091026	0	0	2	200.000		3,1793	3,5192	99	93,7905	93,7905	660,135	8,52	7,57	7	(1.452)		3570
EU	1/14/2041	1/5/2015	T140141	0	0	2	200.000		2,3491	3,5192	118	95,6705	95,6705	673,367	8,7	7,72	7,14	(973)		8781
EU	2/14/2034	1/27/2012	T140234	0	0	2	100.000		1,846556	3,5192	122	117,5694	117,5695	413,751	5,34	4,74	4,39	(952)		6255
EU	7/14/2017	11/15/2016	T140717	0	0	2	200.000		3,2846	3,5192	106	106,45	106,45	749,238	9,68	8,59	7,94	(2.280)		196
EU	1/15/2030	5/27/2011	T150130	5,94	4,08	2	50.000		1,6011	3,5192	173	155,4865	155,4865	273,594	3,53	3,14	2,9	(704)		4764
EU	4/16/2043	11/10/2016	T160443	0	0	2	400.000		3,053553	3,5192	88	81,829	81,829	1.151,890	14,88	13,2	12,21	(1.447)		9603
EU	3/17/2036	12/3/2015	T170336	0	0	2	130.000		2,676885	3,5192	113	105,1324	105,1325	480,977	6,21	5,51	5,1	(962)		7017
EU	3/23/2023	4/6/2016	T230323	0	0	2	20.000		2,8328	3,5192	95	89,674	89,674	63,116	0,82	0,72	0,67	(150)		2274
EU	3/30/2021	11/3/2014	T300321	0	0	2	100.000		2,2067	3,5192	111	104,1084	104,1085	366,379	4,73	4,2	3,88	(918)		1551
			Grup Toplamı				2.155.000				-	0	0	7.743.589		88,76	82,1	(17.547)		
BP	1/2/2017	12/30/2016		9,6	10,07			280.221			280.000	0	0	280.221	100	3,21	2,97	221	-	3
			Grup Toplamı					280.221			-	0	0	280.221		3,21	2,97	221		
			Fon Portföy Değeri				8.724.265				-	0	0	8.724.265		100	92,49	(16.871)		

ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
GRUPLARA YÖNELİK GELİR AMAÇLI 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 (MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	11.727.371	100,00%	96,79%	8.724.265	100,00%	92,49%
B. HAZIR DEĞERLER	11.727.371	100,00%	7,91%	8.724.265	100,00%	92,49%
a) Kasa	958.718	100,00%	-	718.847	100,00%	8,24%
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
i) TL Hesaplar	958.718	100,00%	-	718.847	100,00%	8,24%
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	97	100,00%	-	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Peşin Ödenen Giderler	97	100,00%	-	-	-	-
e) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E. BORÇLAR	570.274	(100,00)%	(4,71)%	10.694	(100,00)%	(0,12)%
a) Takasa Borçlar T1	544.052	(95,40)%	(4,49)%	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	10.584	(1,86)%	(0,09)%	7.931	(74,17)%	(0,09)%
d) Hizmet Komisyonu	-	-	-	-	-	-
e) Pay Geri Alış Borçlar	12.850	(2,25)%	(0,11)%	-	-	-
f) SPK Kayda Alma Ücreti	363	(0,06)%	(0,00)%	283	(2,65)%	(0,00)%
g) Krediler	-	-	-	-	-	-
h) Diğer Borçlar	2.425	(0,43)%	(0,02)%	2.480	(23,19)%	(0,03)%
Fon toplam değeri	12.115.912		100,00	9.432.418		100,00

.....