

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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 YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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. Altın 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 2017 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Altın 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.


Talar Güllü SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 30 Mart 2018

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2017 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tammı	Normal Faiz Oran	Faiz Öde. Sayı	Nominal Değ./Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Iskon. Oran	Borsa Sözle. No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %	FTD %	DEP	VKG
VIOP NAKİT TEMİNAT							3.721.059								3.721.059	28,30%	1,13%	1,11%	TEM	0
Toplam							3.721.059								3.721.059		1,13%	1,11%		
VIOP SÖZLEŞMESİ																				
Uzun Pozisyon				F_USDTRY0218			844	3.881688	28/12/2017				3.8535	1	-	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
				F_XAUUSD0218			1.255	1.295,95	28/12/2017				1.304,90	3,7719	-	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
Ara Toplam															-		0,00%	0,00%		
Toplam															-		0,00%	0,00%		
GRUP TOPLAMI							3.721.060								-		0,00%	0,00%		
E.AL TIN VE DİĞER KİYMETLİ																				
MADENLER																				
ALTIN			ALTIN	ALTIN			2.100	129.908,24	28/12/2017				156.590,48	1	328.840.008	100,00%	99,60%	98,42%	SRB	0
Toplam							2.100								328.840.008		99,60%	98,42%		
GRUP TOPLAMI							2.100								328.840.008		99,60%	98,42%		
G.DİĞER																				
VARLIKLAR																				
BPP		02/01/2018				13,60%	0,000	1.316.960	100.000,00	29/12/2017	14,56%		100.111,76	1	1.316.470	100,00%	0,40%	0,39%	SRB	4
Toplam							1.316.960								1.316.470		0,40%	0,39%		
GRUP TOPLAMI							1.316.960					0			1.316.470		0,40%	0,39%		
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ							1.319.060					0			330.156.478					

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2016 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tanımı	Normal Faiz Oranı	Faiz Öde. Sayı.	Nominal Değ./Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskon. Oranı	Borsa Sözle. No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %	FTD %	DEP	VKG
Ç. TUREV ARAÇLAR																				
Uzun Pozisyon				F TRYUSD0217S0			906	3.576215	28.12.2016				3.5658	1	3.230.615	19,06%	2,39%	2,35%	SRB	0
				F XAUUSD0217S0			3.355	1.158,74	07.12.2016				1.161,65	3,5192	13.715.504	80,94%	10,15%	9,99%	SRB	0
Ara Toplam															16.946.119		12,54%	12,35%		
Toplam															16.946.119		12,54%	12,35%		
GRUP TOPLAMI							-								-		0,00%	0,00%		
E. ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ																				
MADENLER																				
ALTIN			ALTIN	ALTIN			943	107.406,84	28.12.2016				130.523,18	1	123.083.359	98,74%	91,06%	89,68%	SRB	0
			ALTIN	ALTIN			12	130.938,40	30.12.2016				130.523,18	1	1.566.277	1,26%	1,16%	1,14%	SRB	0
Ara Toplam							955								124.649.636	100,00%	92,22%	90,82%		
Toplam							955								124.649.636		92,22%	90,82%		
GRUP TOPLAMI							955								124.649.636		92,22%	90,82%		
G.DİĞER																				
VARLIKLAR																				
BPP		02.01.2017			10,10%	0,000	328.272	100.000,00	30.12.2016	10,62%			100.055,33	1	328.181	3,12%	0,24%	0,24%	SRB	3
		02.01.2017			10,10%	0,000	29.024	100.000,00	30.12.2016	10,63%			100.055,31	1	29.017	0,28%	0,02%	0,02%	SRB	3
Toplam							357.296								357.198		0,26%	0,26%		
VADELİ MEVD-YP	YKB	02.01.2017	33		3,25%		1.000.000	0	30.11.2016				100,284944	3,5192	3.529.228	33,56%	2,61%	2,57%	SRB	3
	FIN	02.02.2017	35		3,45%		1.116.289	0	29.12.2016				100,02906	3,5192	3.929.585	37,36%	2,91%	2,86%	SRB	34
	YKB	02.02.2017	35		3,15%		767.333	0	29.12.2016				100,026606	3,5192	2.701.115	25,68%	2,00%	1,97%	SRB	34
Ara Toplam			35				1.883.621								6.630.700	63,05%	4,91%	4,83%		
Toplam							2.883.621								10.159.928		7,52%	7,40%		
GRUP TOPLAMI							3.240.918					-			10.517.126		7,78%	7,66%		
FONORTAKLİK PORTFÖY DEĞERİ							3.241.873					-			135.166.762					

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ALTIN 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	333.877.537	-	(99,93)%	137.145.293	-	99,93%
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	333.877.533	-	(99,93)%	137.145.293	-	99,93%
B. HAZIR DEĞERLER	8.081	100%	-	10.464	100,00%	0,01%
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	8.081	100%	-	10.464	100,00%	0,01%
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	566.080	100%	(0,17)%	368.361	100,00%	0,27%
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	150.836	40,95%	0,11%
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	566.080	100%	(0,17)%	217.525	59,05%	0,16%
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E. BORÇLAR	325.565	(100,00)%	(0,1)%	126.826	(100,00)%	(0,09)%
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	289.781	(89,01)%	(0,09)%	113.115	(89,19)%	(0,08)%
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	35.784	(10,99)%	(0,01)%	13.711	(10,81)%	(0,01)%
Fon toplam değeri	334.126.133		100,00	137.246.434		100,00

31 Aralık 2017 ve 1 Ocak 2018 tarihlerinin tatil günü olması sebebi ile Fon'un cari dönem sonu itibariyle hazırlanan Performans Sunuş Raporu'nda birim pay değeri hesaplamasında 2 Ocak 2018 tarihinde geçerli olan Fon Toplam Değeri kullanılmıştır.

.....