

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.  
EMANET PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU  
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.  
PARA PİYASASI EMANET LİKİT KAMU  
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.  
EMANET PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU  
(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.  
PARA PİYASASI EMANET LİKİT KAMU  
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 Hayat ve Emeklilik A.Ş. Emanet Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu’nun (Eski Unvanıyla “Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emanet Likit Kamu Emeklilik Yatırım Fonu”) (“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 Hayat ve Emeklilik A.Ş. Emanet Para Piyasası 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 Hayat 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 Gül, SMMM  
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 30 Mart 2018

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**  
**EMANET PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU**  
**(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**  
**PARA PİYASASI EMANET LİKİT KAMU**  
**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 |
|----|-----------|-------------------|--------------------|------------|-----------|-------------------|---------------|-------------------|-----|-------------------|------------------|----------------|---------------|---------|-----------|--------|-------------------|------------------|-----|
| DR | 2.01.2018 | 29.12.2017        | TRT010420T19       | 10,00      | 10,51     | 2                 |               | 200.219           |     | 200.000           | 181,63           | 189,62         | 200.219       | 4,53    | 4,53      | 4,50   | 219               | 110.235          | 4   |
| DR | 2.01.2018 | 29.12.2017        | TRT110320T18       | 10,00      | 10,51     | 2                 |               | 215.236           |     | 215.000           | 99,55            | 101,28         | 215.236       | 4,87    | 4,87      | 4,84   | 236               | 216.215          | 4   |
| DR | 2.01.2018 | 29.12.2017        | TRT210721T11       | 12,30      | 13,08     | 2                 |               | 4.005.392         |     | 4.000.000         | 164,20           | 171,65         | 4.005.392     | 90,60   | 90,60     | 90,09  | 5.392             | 2.439.295        | 4   |
|    |           |                   |                    |            |           |                   |               | 4.420.847         |     | 0                 |                  |                | 4.420.847     |         |           |        |                   |                  |     |
|    |           |                   | Grup Toplamı       |            |           |                   |               |                   |     | 0,00              | 0,00             |                |               |         | 100,00    | 99,43  | 5.847             |                  |     |
|    |           |                   | Fon Portföy Değeri |            |           |                   | 4.420.847     | 0                 | 0   | 0                 | 0                | 0              | 4.420.847     |         | 100,00    | 99,43  | 5.847             |                  |     |

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**  
**EMANET PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU**  
**(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**  
**PARA PİYASASI EMANET LİKİT KAMU**  
**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 | 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       | 7,51       | 7,8       | 2                 |               | 36.022            |     | 36.000            | 125,120597       | 132,646133     | 36.022        | 0,91    | 0,91      | 0,91   | 22,22             | 28.790           | 3   |
| DR | 02.01.2017 | 42.734,00         | TRT020823T11       | 7,51       | 7,8       | 2                 |               | 409.252           |     | 409.000           | 125,121134       | 132,646133     | 409.252       | 10,37   | 10,37     | 10,32  | 252,46            | 327.085          | 3   |
| DR | 02.01.2017 | 42.734,00         | TRT020823T11       | 8          | 8,33      | 2                 |               | 3.502.301         |     | 3.500.000         | 125,122857       | 132,646133     | 3.502.301     | 88,72   | 88,72     | 88,34  | 2.301,37          | 2.799.090        | 3   |
|    |            |                   | Grup Toplamı       |            |           |                   |               | 3.947.576         |     | 0                 | 0                | 0              | 3.947.576     |         | 100       | 99,58  | 2.576,05          |                  |     |
|    |            |                   | Fon Portföy Değeri |            |           |                   | 3.947.576     |                   |     | 0                 | 0                | 0              | 3.947.576     |         | 100       | 99,58  | 2.576,05          |                  |     |

**ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**  
**EMANET PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU**  
**(Eski Unvanıyla “ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.**  
**PARA PİYASASI EMANET LİKİT KAMU**  
**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<br>TL      | Grup<br>% | Toplam<br>%   | Tutar<br>TL      | Grup<br>% | Toplam<br>%   |
| A. FON PORTFÖY DEĞERİ<br>(MİZANDAN PORTFÖY<br>DEĞERİ) | 4.420.847        | 100,00%   | 99,43%        | 3.947.575        | 100,00%   | 99,58%        |
| B. HAZIR DEĞERLER                                     | 14.442           | 100,00%   | 0,32%         | 11.445           | 100,00%   | 0,29%         |
| a) Kasa                                               | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| b) Bankalar                                           | 14.442           | 100,00%   | 0,32%         | 11.445           | 100,00%   | 0,29%         |
| i) TL Hesaplar                                        | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| ii) Yabancı Para TL Karşılığı                         | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| iii) VOB Nakit Teminatları<br>(Alacakları)            | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| c) Diğer Hazır Değerler                               | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| C. ALACAKLAR                                          | 16.597           | 100,00%   | 0,37%         | 11.562           | 100,00%   | 0,29%         |
| a) Takastan Alacaklar T1                              | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| b) Takastan Alacaklar T2                              | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| c) Kurucudan Alacaklar                                | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| d) Peşin Ödenen Giderler                              | 122              | 0,73%     | -             | -                | -         | -             |
| e) Diğer Alacaklar                                    | 16.475           | 99,27%    | 0,37%         | 11.562           | 100,00%   | 0,29%         |
| D. DİĞER VARLIKLAR                                    | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| E. BORÇLAR                                            | 5.829            | (100,00)% | (0,13)%       | 6.229            | (100,00)% | (0,16)%       |
| a) Takasa Borçlar T1                                  | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| b) Takasa Borçlar T2                                  | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| c) Yönetim Ücreti                                     | 4.155            | (71,28)%  | (0,09)%       | 4.329            | (69,50)%  | (0,11)%       |
| d) Ödenecek Vergi                                     | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| e) Hizmet Komisyonu                                   | -                | -         | -             | -                | -         | -             |
| f) SPK Kayda Alma Ücreti                              | 133              | (2,29)%   | (0,00)%       | 119              | (1,91)%   | (0,00)%       |
| g) Diğer Borçlar                                      | 1.541            | (26,43)%  | (0,03)%       | 1.781            | (28,59)%  | (0,05)%       |
| <b>Fon toplam değeri</b>                              | <b>4.446.056</b> |           | <b>100,00</b> | <b>3.964.354</b> |           | <b>100,00</b> |

.....