

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş.
Birinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım
Fonu

Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden
Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu
İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak
Hazırlanmasına İlişkin Bağımsız Denetçi Raporu



KPMG Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.
İş Kuleleri Kule 3 Kat:2-9
Levent 34330 İstanbul
Tel +90 212 316 6000
Fax +90 212 316 6060
www.kpmg.com.tr

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Birinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş Birinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin 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 2021 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş Birinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

KPMG Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.

Ali Tuğrul Uzun, SMMM
Sorumlu Denetçi

29 Nisan 2022
İstanbul, Türkiye

Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (4)

Allianz Hayat Ve Emeklilik A.Ş. Birinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu																	
31 Aralık 2020 Tarihli																	
Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)																	
Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı	Vade	ISIN	Menkul	Normal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme NO	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %
B.BORÇLANMA ARAÇLARI																	
B1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI																	
EURO TAHVİL	T.S.K.R.	18.05.2021	XS1412389172	TSKB180521		2	2.200.000	107	12.03.2020				101	7	16.591.169	37,52%	2,08%
	Türkiye Vakıflar Bankası	27.10.2021	XS1508914691	YKB8N271021		2	750.000	101	31.10.2017				102	7	5.679.987	12,91%	0,72%
	Yapı ve Kredi Bankası	06.12.2022	XS0861979440	YKB061222		2	700.000	101	14.09.2017				7	7	5.230.402	11,89%	0,66%
	Koç Holding	11.03.2025	XS1961766596	XS1961766596		3	800.000	99	11.03.2019				111	7	6.575.874	14,95%	0,83%
	Akbank	06.02.2026	XS2131335270	XS2131335270		2	1.000.000	100	08.07.2020				109	7	8.105.383	18,43%	1,02%
Toplam							5.450.000								42.093.014		5,30%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	Yapı ve Kredi Bankası	20.06.2029	TRSYKKBG2914	TRSYKKBG2914	6,36%	4	1.800.000	100	03.07.2019		0		105	1	1.892.070	4,30%	0,24%
Toplam							1.800.000								1.892.070		0,24%
GRUP TOPLAMI							7.250.000								43.985.084		5,54%
B2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI																	
EURO TAHVİL	T.C. Hazine Müsteşarlığı	25.03.2022	US900123BY51	T250322	2,56%	2	5.390.000	100	19.10.2020				104	7	41.616.782	5,87%	5,24%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	26.09.2022	US900123BZ27	T260922	3,13%	2	12.660.000	104	16.10.2020				107	7	100.035.498	14,11%	12,60%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	23.03.2023	US900123CA66	T230323	1,63%	2	500.000	96	13.07.2020				101	7	3.736.543	0,53%	0,47%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	22.03.2024	US900123CF53	T220324	2,08%	2	5.800.000	106	24.11.2020				107	7	46.043.721	6,49%	5,80%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	10.08.2024	US900123CV04	US900123CV04	3,18%	2	500.000	103	08.10.2020				110	7	4.080.503	0,58%	0,51%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.11.2024	US900123CW86	US900123CW86	2,80%	2	3.000.000	102	28.07.2020				106	7	23.539.827	3,32%	2,96%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	05.02.2025	US900123AW05	T050225	3,69%	2	4.000.000	114	30.11.2020				115	7	34.068.401	4,81%	4,29%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.10.2025	US900123CZ18	US900123CZ18	3,19%	2	1.000.000	100	20.10.2020				110	7	8.134.964	1,13%	1,02%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.04.2026	US900123CJ75	T140426	2,13%	2	125.000	92	15.08.2018				100	7	929.479	0,13%	0,12%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	09.10.2026	US900123CK49	T091026	2,44%	2	4.800.000	99	11.07.2017				103	7	36.503.448	5,15%	4,60%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	25.03.2027	US900123CL22	T250327	3,00%	2	3.400.000	100	15.12.2020				108	7	27.238.361	3,84%	3,43%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.02.2028	US900123CP36	US900123CP36	2,56%	2	965.020	90	28.04.2020				103	7	7.556.569	1,07%	0,95%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	24.10.2028	US900123CQ19	US900123CQ19	3,06%	2	3.200.000	97	30.10.2020				108	7	25.638.241	3,62%	3,25%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	26.04.2029	US900123CT57	US900123CT57	3,81%	2	2.300.000	100	02.04.2019				117	7	19.986.595	2,82%	2,52%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	13.03.2030	US900123CY43	US900123CY43	2,63%	2	500.000	101	23.12.2020				102	7	3.790.013	0,53%	0,48%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	15.01.2031	US900123DA57	US900123DA57	2,98%	2	2.500.000	102	15.12.2020				105	7	19.467.405	2,75%	2,45%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.02.2034	US900123AT75	T140234	4,00%	2	4.280.000	118	11.06.2020				123	7	39.003.753	5,50%	4,91%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.03.2036	US900123AY60	T170336	3,44%	2	7.416.000	109	09.07.2019				111	7	61.180.363	8,63%	7,71%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	05.03.2038	US900123BH58	T050338	3,63%	2	700.000	113	23.12.2020				115	7	5.980.667	0,84%	0,75%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	30.05.2040	US900123BQ46	T300540	3,38%	2	5.770.000	109	23.12.2020				108	7	46.026.460	6,49%	5,80%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.01.2041	US900123BB04	T140141	3,00%	91	2.370.000	91	29.12.2020				102	7	55.639.809	7,85%	7,01%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	16.04.2043	US900123CB40	T160443	2,44%	2	1.000.000	81	05.10.2020				89	7	6.602.042	0,93%	0,83%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.02.2045	US900123CG37	T170245	3,31%	2	10.056.000	92	27.11.2020				107	7	80.195.872	11,31%	10,10%
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	11.05.2047	US900123CM05	US900123CM05	2,98%	2	1.673.000	87	27.11.2020				96	7	11.962.822	1,69%	1,51%
Toplam							88.925.000								708.961.401		89,29%
GRUP TOPLAMI							88.925.000								708.961.401		89,29%
TOPLAM							96.175.000								752.946.486		94,83%
C.TUREV ARAÇLAR																	
VIOP NAKIT TEMİNAT							7.873.983								7.873.983	-14,58%	0,99%
Toplam							7.873.983								7.873.983		0,99%
VIOP SÖZLEŞMESİ																	
Kısa Pozisyon				F_USDTRY0221			8.156		8/24.12.2020				8	1	0	0,00%	0,00%
Ara Toplam															0		0,00%
Toplam															0		0,00%
GRUP TOPLAMI							7.873.983								0		0,00%
G.DİĞER VARLIKLAR																	
BPP		04.01.2021			17,80%	0	517.007	100.000	31.12.2020		0,1946		100,049	1	516.251	1,56%	0,07%
Toplam							517.007								516.251		0,07%
VADELİ MEVD-YP	YKB	04.01.2021		4	0,20%		1.430.000		03.11.2020				100	7	10.699.800	31,99%	1,34%
Toplam							1.430.000								10.699.800		1,34%
VADELİ MEVDUAT	YKB	14.01.2021		35	17,10%		11.228.284		01.10.2020				101	1	11.343.848	34,21%	1,43%
	YKB	21.01.2021		37	17,10%		5.068.279		01.15.2020				101	1	5.108.586	15,40%	0,64%
Toplam							16.296.563								16.452.434		2,07%
YATIRIM FONU KATILMA PAYLARI				YLB			17.523.526		0/24.10.2019				0	1	5.585.554	16,84%	0,70%
Toplam							17.523.526								5.585.554		0,70%
GRUP TOPLAMI							35.767.095						0		33.164.039		4,18%
FONORTAKLILIK PORTFÖY DEĞERİ							131.942.095						0		793.984.507		

Allianz Hayat Ve Emeklilik A.Ş. Birinci Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2021 Tarihli
Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (b)
(Tüm tutarlar TL olarak gösterilmiştir)

TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

	31 Aralık 2021			31 Aralık 2020		
	TUTARI (TL)	GRUP %	TOPLAM %	TUTARI (TL)	GRUP %	TOPLAM %
A.FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	1.328.019.140		99	793.984.507	100	101
(MİZANDA PORTFÖY DEĞERİ)	1.328.019.140		99	793.984.509		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	16.119.713		1	11.194	100	0
a) Kasa	0	0	0	0	0	0
b) Bankalar	16.119.713	100	1	11.194	100	0
c) Diğer Hazır Değerler	0	0,00	0	0	0	0
		0	0			
C.ALACAKLAR (+)	86.975		0	238.647		0
a) Takastan Alacaklar T1	0	0	0	0	0	0
b) Takastan Alacaklar T2	0		0	0		0
c) Diğer Alacaklar	86.975	100	0	238.647	100	0
		0	0			
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	0		0	0		0
		0	0			
E. BORÇLAR	(6.328.012)		(0)	(5.684.307)		(1)
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	0	0	0
b) Takasa Borçlar T2	0	0	0	0	0	0
c) Yönetim Ücreti	(2.200.826)	35	(0)	(1.281.405)	23	(0)
d) Ödenecek Vergi	0	0	0	0	0	0
e) İhtiyatlar	0	0	0	0	0	0
f) Krediler	0	0	0	0	0	0
g) Diğer Borçlar	(4.127.186)	65	(0)	(4.402.902)	77	(1)
F.M.D Düşüş Karşılığı	0		0	0	0	0
Fon Toplam Değeri	1.337.897.815		100	788.550.041		100