

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş.
Kamu Dış Borçlanma Araçları Grup 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. Kamu Dış Borçlanma Araçları Grup 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. Kamu Dış Borçlanma Araçları Grup 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. Kamu Dış Borçlanma Araçları Grup 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

Allianz Hayat Ve Emeklilik A.Ş. Kamu Dış Borçlanma Araçları Grup Emeklilik Yatırım Fonu
 31 Aralık 2021 Tarihli
 Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Menkul Kıymet	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tanımı	Normal Faiz Oranı	Faiz Ode. Sayı.	Nominal Deg./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 %
B.BORÇLANMA ARAÇLARI																	
B1.OZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI																	
EURO TAHVİL	Akbank	06.02.2026	XS2131335270	XS2131335270	3,40%	2,000	200.000	100,02	08.07.2020				99,6505	13,329	2.656.483	100,00%	7,06%
Toplam							200.000										
GRUP TOPLAMI							200.000										
B2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI																	
EURO TAHVİL	Hazine ve Maliye Bakanlığı	25.03.2022	US900123BY51	T250322	2,56%	2,000	200.000	103,114515	18.05.2021				101,618	13,329	2.708.933	8,29%	7,20%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	26.09.2022	US900123BZ27	T260922	3,13%	2,000	100.000	105,65903	09.02.2021				102,531	13,329	1.366.636	4,18%	3,63%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	23.03.2023	US900123CA66	T230323	1,63%	2,000	9.000	90,150529	06.07.2018				98,2825	13,329	117.901	0,36%	0,31%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	23.12.2023	US900123CR91	US900123CR91	3,63%	2,000	60.000	109,456681	28.02.2020				101,577	13,329	812.352	2,49%	2,16%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	22.03.2024	US900123CF53	T220324	2,88%	2,000	30.000	100,135053	23.05.2019				99,5075	13,329	397.901	1,22%	1,06%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	14.11.2024	US900123CW86	US900123CW86	2,80%	2,000	200.000	105,85111	28.01.2020				97,3865	13,329	2.596.129	7,95%	6,90%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	05.02.2025	US900123AW05	T050225	3,69%	2,000	335.000	107,339197	06.08.2020				104,0395	13,329	4.645.587	14,22%	12,34%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	09.10.2026	US900123CK49	T091026	2,44%	2,000	85.000	93,459693	06.08.2020				91,902	13,329	1.041.217	3,19%	2,77%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	25.03.2027	US900123CL22	T250327	3,00%	2,000	90.000	100,690769	20.11.2019				96,072	13,329	1.152.489	3,53%	3,06%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	17.02.2028	US900123CP36	US900123CP36	2,56%	2,000	20.000	96,5264	13.12.2019				91,687	13,329	244.419	0,75%	0,65%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	26.04.2029	US900123CT57	US900123CT57	3,81%	2,000	100.000	108,511806	06.11.2019				101,4925	13,329	1.352.794	4,14%	3,59%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	15.01.2031	US900123DA57	US900123DA57	2,98%	2,000	200.000	99,80253	03.12.2020				92,391	13,329	2.462.959	7,54%	6,54%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	26.06.2031	US900123DC14	US900123DC14	2,94%	2,000	200.000	99,46	26.01.2021				89,0495	13,329	2.373.882	7,27%	6,31%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	14.02.2034	US900123AT75	T140234	4,00%	2,000	300.000	118,561097	10.04.2018				107,249	13,329	4.288.566	13,13%	11,39%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	17.03.2036	US900123AY60	T170336	3,44%	2,000	171.000	109,843409	28.02.2019				96,018	13,329	2.188.499	6,70%	5,81%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	05.03.2038	US900123BB58	T050338	3,63%	2,000	40.000	116,7531	08.10.2014				99,4555	13,329	530.257	1,62%	1,41%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	30.05.2040	US900123BG46	T300540	3,38%	2,000	30.000	107,3375	14.02.2020				90,964	13,329	363.738	1,11%	0,97%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	16.04.2043	US900123CB40	T160443	2,44%	2,000	180.000	81,736654	15.12.2020				78,015	13,329	1.871.751	5,73%	4,97%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	17.02.2045	US900123CG37	T170245	3,31%	2,000	162.000	88,022079	20.08.2020				91,195	13,329	1.969.172	6,03%	5,23%
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	11.05.2047	US900123CM05	US900123CM05	2,88%	2,000	16.000	93,757626	16.02.2021				81,985	13,329	174.844	0,46%	0,40%
Toplam							2.528.000								32.660.026		86,77%
GRUP TOPLAMI							2.528.000								32.660.026		86,77%
TOPLAM							2.728.000								35.316.509		93,83%
C.TUREV ARAÇLAR																	
VIOP NAKİT TEMİNAT								0								0,00%	0,00%
Toplam							0								0		0,00%
GRUP TOPLAMI							0								0		0,00%
G.DİĞER VARLIKLAR																	
TERS REPO - DT		03.01.2022	TRT140126T11	TRT140126T11	14,01%		2.002.303	245,9541	31.12.2021	15,03%		813.160,00	246,048426	1	2.000.767	86,08%	5,32%
Toplam							2.002.303								2.000.767		5,32%
TPP		03.01.2022			14,55%	0,000	86.103	100.000,00	31.12.2021	15,65%			100.039,85	1	86.034	3,70%	0,23%
Toplam							86.103								86.034		0,23%
YATIRIM FONU KATILMA PAYLARI	(YLB) YAPI KREDİ PORTFÖY PARA PIYASASI FONU			YLB			632.222	0,28471	24.10.2019				0,375484	1	237.389	10,21%	0,63%
Toplam							632.222								237.389		0,63%
GRUP TOPLAMI							2.720.628					813.160,00			2.324.191		6,17%
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ							5.448.628					813.160,00			37.640.700		

Allianz Hayat Ve Emeklilik A.Ş. Kamu Dış Borçlanma Araçları Grup Emeklilik Yatırım Fonu
 31 Aralık 2020 Tarihli
 Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Menkul Kıymet	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tanımı	Normal Faiz Oranı	Faiz Ode. Sayı.	Nominal Deg./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 %	
B.BORÇLANMA ARAÇLARI																		
B1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI																		
EURO TAHVİL	Akbank	06.02.2026	XS2131335270	XS2131335270	3,40%	2,000	200.000	100,02	08.07.2020				109,2485	7,4194	1.621.117	100,00%	6,49%	
Toplam							200.000								1.621.117		6,49%	
GRUP TOPLAMI							200.000								1.621.117		6,49%	
B2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI																		
EURO TAHVİL	T.C. Hazine Müsteşarlığı	30.03.2021	US900123BH29	T300321	2,81%	2,000	120.000	104,775278	11.02.2020				102,3255	7,4194	911.033	4,27%	3,65%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	26.09.2022	US900123BZ27	T260922	3,13%	2,000	100.000	101,55903	03.07.2018				106,5005	7,4194	790.170	3,71%	3,16%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	23.03.2023	US900123CA66	T230323	1,63%	2,000	9.000	90,150529	06.07.2018				100,7775	7,4194	67.294	0,32%	0,27%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	23.12.2023	US900123CR91	US900123CR91	3,63%	2,000	260.000	109,456681	28.02.2020				109,562	7,4194	2.113.499	9,91%	8,46%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	22.03.2024	US900123CF53	T220324	2,88%	2,000	30.000	100,135053	23.05.2019				106,9975	7,4194	238.157	1,12%	0,95%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.11.2024	US900123CW86	US900123CW86	2,80%	2,000	200.000	105,85111	28.01.2020				105,758	7,4194	1.569.322	7,36%	6,28%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	05.02.2025	US900123AW05	T050225	3,69%	2,000	335.000	107,339197	06.08.2020				114,795	7,4194	2.853.229	13,38%	11,42%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	09.10.2026	US900123CK49	T091026	2,44%	2,000	85.000	93,459693	06.08.2020				102,5	7,4194	646.415	3,03%	2,59%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	25.03.2027	US900123CL22	T250327	3,00%	2,000	90.000	100,680769	20.11.2019				107,9775	7,4194	721.015	3,38%	2,89%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.02.2028	US900123CP36	US900123CP36	2,56%	2,000	20.000	96,5264	13.12.2019				103,405	7,4194	153.441	0,72%	0,61%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	26.04.2029	US900123CT57	US900123CT57	3,81%	2,000	100.000	108,511806	06.11.2019				117,123	7,4194	868.982	4,08%	3,48%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	15.01.2031	US900123DA57	US900123DA57	2,98%	2,000	200.000	99,80253	03.12.2020				104,9545	7,4194	1.557.399	7,30%	6,23%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.02.2034	US900123AT75	T140234	4,00%	2,000	300.000	118,561097	10.04.2018				122,827	7,4194	2.733.908	12,82%	10,94%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.03.2036	US900123AY60	T170336	3,44%	2,000	171.000	109,843409	28.02.2019				111,192	7,4194	1.410.712	6,62%	5,65%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	05.03.2038	US900123BB58	T050338	3,63%	2,000	40.000	116,7531	08.10.2014				115,155	7,4194	341.752	1,60%	1,37%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	30.05.2040	US900123BG46	T300540	3,38%	2,000	30.000	107,3375	14.02.2020				107,5135	7,4194	239.306	1,12%	0,96%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	14.01.2041	US900123BJ84	T140141	3,00%	2,000	200.000	90,104348	23.11.2020				101,7535	7,4194	1.509.900	7,08%	6,04%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	16.04.2043	US900123CB40	T160443	2,44%	2,000	180.000	81,736654	15.12.2020				88,9835	7,4194	1.188.368	5,57%	4,76%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	17.02.2045	US900123CG37	T170245	3,31%	2,000	162.000	88,022079	20.08.2020				107,4875	7,4194	1.291.938	6,06%	5,17%	
	T.C. Hazine Müsteşarlığı	11.05.2047	US900123CM05	US900123CM05	2,88%	2,000	16.000	93,639597	23.07.2020				96,376	7,4194	114.408	0,54%	0,46%	
Toplam							2.648.000								21.320.248		85,32%	
GRUP TOPLAMI							2.648.000								21.320.248		85,32%	
TOPLAM							2.848.000								22.941.364		91,81%	
C.TUREV ARAÇLAR																		
VIOP NAKİT TEMİNAT								272.000								272.000	-45,90%	1,09%
Toplam								272.000								272.000		1,09%
VIOP SÖZLEŞMESİ																		
Kısa Pozisyon				F_USDTRY0221			114	7,55	29.12.2020				7,5837	1	0	0,00%	0,00%	
Ara Toplam															0	0,00%	0,00%	
Toplam															0	0,00%	0,00%	
GRUP TOPLAMI							272.000								0	0,00%	0,00%	
G.DİĞER VARLIKLAR																		
TERS REPO - DT		04.01.2021	TRT070727T13	TRT070727T13	17,90%		1.001.962	164,0164	31.12.2020	19,58%		609.695,00	164,096811	1	1.000.490	56,39%	4,00%	
Toplam							1.001.962								1.000.490		4,00%	
BPP		04.01.2021		YLB	17,80%	0,000		100.000,00	31.12.2020	19,46%			100,048,73	1	572.279	32,25%	4,00%	
Toplam							573.116								572.279		2,29%	
YATIRIM FONU KATILMA PAYLARI							632.222	0,28471	24.10.2019				0,318746	1	201.518	11,36%	2,29%	
Toplam							632.222								201.518		0,81%	
GRUP TOPLAMI							2.207.299					609.695,00			1.774.287		7,10%	
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ							5.055.299					609.695,00			24.987.652			

Allianz Yaşam Ve Emeklilik A.Ş. Kamu Dış Borçlanma Araçları Grup 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	37.640.700		98	24.987.652		100
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	37.640.700		98	24.987.652		100
B. HAZIR DEĞERLER	790.926		2	10.782		0
a) Kasa	0	0	0	0	0	0
b) Bankalar	790.926	100	2	10.782	100	0
c) Diğer Hazır Değerler	0	0	0	0	0	0
C.ALACAKLAR	277		0	235	100	0
a) Takastan Alacaklar T1	0	0	0	0	0	0
b) Takastan Alacaklar T2	0	0	0	0	0	0
c) Takastan BPP Alacakları	0	0	0	0	0	0
d) Diğer Alacaklar	277	100	0	235	100	0
D. DİĞER VARLIKLAR	0		0	0		0
E. BORÇLAR (-)	(169.497)		0	(98.435)		0
a) Takasa Borçlar T1	0	0	0	0	0	0
a) Takasa Borçlar T2	0	0	0	0	0	0
c) Yönetim Ücreti	(31.981)	19	0	(21.101)	21	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	(137.516)	81	0	(77.334)	79	0
F.M.D Düşüş Karşılığı	0		0	0		0
Fon Toplam Değeri	38.262.405		100	24.900.234		100