

AvivaSA Hayat ve Emeklilik A.Ş.
Gelir Amaçlı Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik
Yatırım Fonu (AE2)

31 Aralık 2016 hesap dönemine ait
Fiyat Raporu

**AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş. Para
Gelir Amaçlı Kamu 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 Rapor**

AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş. Gelir Amaçlı Kamu 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 2016 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş. Gelir Amaçlı Kamu 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 AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik Anonim Şirketi
A member firm of Ernst&Young Global Limited



İstanbul, 27 Mart 2017

AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş.

Gelir Amaçlı Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu (AE2)
31 Aralık 2016 Tarihli Fiyat Raporu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (%)
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili															
TRT040117T14	TL	HAZİNE	04/01/17		0,00	67.000.000,00	102,020200	30/12/16	8,658569			102,080304	68.393.803,67	2,95	2,36
TRT080317T18	TL	HAZİNE	08/03/17		0,00	74.798,00	101,565400	07/11/16	8,489174			102,971646	77.020,73	0,00	0,00
TRT140617T17	TL	HAZİNE	14/06/17		0,00	45.575,00	104,445000	30/12/16	8,760262			100,919398	45.994,02	0,00	0,00
TRT200917T16	TL	HAZİNE	20/09/17		0,00	23.900.000,00	92,200600	30/12/16	9,593270			93,635989	22.379.001,31	0,97	0,77
TRT251017T18	TL	HAZİNE	25/10/17		0,00	400.000,00	98,573000	01/04/13	10,006995			100,874138	403.496,55	0,02	0,01
TRT140218T10	TL	HAZİNE	14/02/18		0,00	2.579.881,00	98,725100	30/12/16	9,994112			98,789088	2.548.640,91	0,11	0,09
TRT200618T18	TL	HAZİNE	20/06/18		0,00	19.000.000,00	100,709400	30/12/16	10,451405			97,759449	18.574.295,26	0,80	0,64
TRT110718T18	TL	HAZİNE	11/07/18		0,00	253.000.000,00	101,736000	30/12/16	10,678148			101,789765	257.528.106,48	11,15	8,87
TRT141118T19	TL	HAZİNE	14/11/18		0,00	129.338.137,00	97,416200	29/12/16	10,708243			98,418583	127.292.761,86	5,49	4,38
TRT200219T11	TL	HAZİNE	20/02/19		0,00	200.000,00	129,712200	29/12/16	2,128287			130,273181	260.546,36	0,01	0,01
TRT270319T13	TL	HAZİNE	27/03/19		0,00	126.500.000,00	103,582300	30/12/16	10,892349			102,328104	129.445.051,96	5,59	4,46
TRT100719T18	TL	HAZİNE	10/07/19		0,00	998.686,00	99,335100	29/12/16	10,730419			99,822519	996.913,52	0,04	0,03
TRT150120T16	TL	HAZİNE	15/01/20		0,00	100.000,00	104,873100	29/12/16	10,700566			105,005400	105.005,40	0,00	0,00
TRT050220T17	TL	HAZİNE	05/02/20		0,00	163.634.942,00	94,990100	30/12/16	11,108970			94,175157	154.103.464,00	6,65	5,31
TRT110320T18	TL	HAZİNE	11/03/20		0,00	16.100.000,00	99,996000	27/09/16	10,130184			99,764546	16.062.091,87	0,69	0,55
TRT010420T19	TL	HAZİNE	01/04/20		0,00	10.934.757,00	173,427300	30/11/16	2,608411			172,227480	18.832.656,42	0,81	0,65
TRT080720T19	TL	HAZİNE	08/07/20		0,00	49.500.000,00	99,575000	29/12/16	11,039656			100,639832	49.816.716,60	2,15	1,72
TRT111120T18	TL	HAZİNE	11/11/20		0,00	38.500.000,00	99,124800	30/12/16	10,017300			97,690319	37.610.772,66	1,62	1,30
TRT170221T12	TL	HAZİNE	17/02/21		0,00	154.450.000,00	104,565100	30/12/16	11,146714			103,394493	159.692.794,46	6,89	5,50
TRT190521T17	TL	HAZİNE	19/05/21		0,00	200.000,00	99,287700	25/11/16	10,212774			97,460652	194.921,30	0,01	0,01
TRT210721T11	TL	HAZİNE	21/07/21		0,00	31.510.385,00	152,618100	30/12/16	2,792201			153,655225	48.417.353,08	2,09	1,67
TRT220921T18	TL	HAZİNE	22/09/21		0,00	228.200.000,00	96,713800	28/12/16	11,237115			96,180665	219.484.277,30	9,47	7,56
TRT120122T17	TL	HAZİNE	12/01/22		0,00	67.710.008,00	101,543200	29/12/16	11,313676			98,677053	66.814.240,53	2,88	2,30
TRT200422T14	TL	HAZİNE	20/04/22		0,00	75.900.000,00	98,762900	31/10/16	9,984005			97,507973	74.008.551,87	3,19	2,55
TRT140922T17	TL	HAZİNE	14/09/22		0,00	21.694.710,00	91,257000	29/12/16	11,371344			91,812324	19.918.417,45	0,86	0,69
TRT080323T10	TL	HAZİNE	08/03/23		0,00	40.772.076,00	87,042700	29/12/16	11,420385			84,586195	34.487.547,82	1,49	1,19
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/08/23		0,00	37.567,00	99,047300	05/12/13	2,827022			132,787866	49.884,42	0,00	0,00
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23		0,00	93.844.084,00	93,905000	29/12/16	11,405164			91,509260	85.876.027,10	3,71	2,96
TRT200324T13	TL	HAZİNE	20/03/24		0,00	114.708.809,00	105,165500	29/12/16	11,428233			99,316021	113.924.224,71	4,92	3,92
TRT240724T15	TL	HAZİNE	24/07/24		0,00	182.485.567,00	93,670700	29/12/16	11,426495			93,199305	170.075.280,19	7,34	5,86
TRT120325T12	TL	HAZİNE	12/03/25		0,00	68.100.000,00	87,280300	30/12/16	11,468370			85,657748	58.332.926,55	2,52	2,01
TRT140126T11	TL	HAZİNE	14/01/26		0,00	100.000,00	105,952600	26/05/16	2,908276			106,295312	106.295,31	0,00	0,00
TRT110226T13	TL	HAZİNE	11/02/26		0,00	229.700.000,00	102,117000	29/12/16	11,433877			100,967342	231.921.983,50	10,01	7,99
GRUP TOPLAMI						2.211.219.982							2.187.781.065	94,43	75,36

AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş.

Gelir Amaçlı Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu (AE2)

31 Aralık 2016 Tarihli Fiyat Raporu

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

Özel Sektör													
Finansman Bonosu													
TRFKPTL31716	TL	KAPİTAL FACTORING	03/03/17	12,50	530.000,00	94,254000	14/12/16	11,944714		98,131934	520.099,25	0,02	0,02
TRFDSTF41716	TL	DESTEK FAKTORING	04/04/17	13,00	950.000,00	94,006000	07/10/16	12,544254		97,033813	921.821,22	0,04	0,03
TRFULFK41714	TL	ULUSAL FAKTORING	06/04/17	13,50	2.260.000,00	94,117000	19/10/16	13,407465		96,778348	2.187.190,66	0,09	0,08
TRFDSTF51715	TL	DESTEK FAKTORING	23/05/17	13,00	780.000,00	94,006000	25/11/16	12,192347		95,622974	745.859,20	0,03	0,03
GRUP TOPLAMI					4.520.000						4.374.970	0,18	0,16
Özel Sektör Tahvil													
TRSCLE11711	TL	CLKEN	27/01/17	0,00	2.650.000,00	100,889800	15/02/16	12,688389		102,270744	2.710.174,71	0,12	0,09
TRSZFKL21718	TL	ZİRAAT FİNANSAL KİRALAMA	16/02/17	0,00	400.000,00	101,546600	31/12/15	10,968342		101,547798	406.191,19	0,02	0,01
TRSZORN21711	TL	ZOREN	16/02/17	0,00	5.191.000,00	100,345000	29/11/16	14,352131		101,684932	5.278.464,81	0,23	0,18
TRSULFK21719	TL	ULUSAL FAKTORING	27/02/17	0,00	500.000,00	101,784700	31/12/15	13,054371		101,748777	508.743,88	0,02	0,02
TRFKORT31716	TL	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	27/03/17	13,99	2.520.000,00	100,000000	28/03/16	15,252752		100,234317	2.525.904,79	0,11	0,09
TRSKORT31719	TL	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	27/03/17	0,00	3.190.000,00	100,269500	30/06/16	15,127010		100,259801	3.198.287,65	0,14	0,11
TRSULFK41717	TL	ULUSAL FAKTORING	06/04/17	0,00	600.000,00	99,999000	02/03/16	12,068863		103,138758	618.832,55	0,03	0,02
TRSTBT41711	TL	TEB TÜKETİCİ FİNANSMAN A.Ş.	11/04/17	0,00	1.000.000,00	102,105800	29/06/16	11,303339		102,437708	1.024.377,08	0,04	0,04
TRSEKIM41713	TL	EKİM TURİZM TİCARET VE SANAYİ A.Ş.	17/04/17	0,00	393.750,00	100,000000	17/10/16	12,957683		102,580555	403.910,93	0,02	0,01
TRSEMAY41711	TL	EMAY İNŞAAT TAHHUT SAN.TİC.A.Ş.	19/04/17	0,00	350.000,00	103,267400	31/12/15	13,685870		102,827724	359.897,03	0,02	0,01
TRMLPCA1710	TL	MEDİCAL PARK SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	25/04/17	0,00	2.700.000,00	102,308600	25/12/15	13,794661		102,454964	2.766.284,02	0,12	0,10
TRSZORN51718	TL	ZOREN	18/05/17	0,00	3.250.000,00	103,071800	11/02/16	15,637574		101,285616	3.291.782,51	0,14	0,11
TRSKORT81714	TL	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	16/08/17	0,00	6.810.000,00	101,698000	26/05/16	14,788837		101,651755	6.922.484,53	0,30	0,24
TRSBOP91716	TL	ALTINYILDIZ	29/09/17	0,00	4.000.000,00	100,914300	15/02/16	18,093662		98,141963	3.925.678,52	0,17	0,14
TRSRNSHE1718	TL	RÖNESANS HOLDİNG	10/10/17	0,00	4.100.000,00	100,140000	20/10/16	12,143106		102,617681	4.207.324,94	0,18	0,14
TRSZORNK1720	TL	ZORLU ELEKTRİK ÜRETİM A.Ş.	02/11/17	13,87	2.900.000,00	100,000000	27/10/16	14,070649		102,658048	2.977.083,39	0,13	0,10
TRSKORTK1713	TL	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	20/11/17	13,60	4.500.000,00	100,000000	17/08/16	14,782636		102,153795	4.596.920,79	0,20	0,16
TRSMLPCA1717	TL	MEDİCAL PARK SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	05/12/17	14,66	710.000,00	100,000000	23/11/16	15,914443		100,922992	716.553,25	0,03	0,02
TRSCICA1713	TL	İC İÇTAŞ ENERJİ YATIRIM HOLDİNG A.Ş.	15/12/17	15,10	1.300.000,00	100,000000	26/05/16	16,141894		100,662231	1.308.609,01	0,06	0,05
TRSDSTF11811	TL	DESTEK FAKTORING	12/01/18	12,31	620.000,00	100,000000	19/07/16	12,890327		102,967667	638.399,53	0,03	0,02
TRSBMKS11810	TL	BMEKS	26/01/18	0,00	1.260.000,00	100,337000	05/12/16	15,435615		100,727568	1.269.167,35	0,05	0,04
TRSZORN11811	TL	ZOREN	30/01/18	0,00	7.400.000,00	100,316200	11/02/16	13,935273		102,334870	7.572.780,41	0,33	0,26
TRRSYG211818	TL	RÖNESANS GAYRİMENKUL Y.O	21/02/18	0,00	1.940.000,00	101,265800	24/11/16	12,548227		102,379591	1.986.164,06	0,09	0,07
TRSKORT31818	TL	KORTEKS MENSUCAT A.Ş.	26/03/18	14,49	1.430.000,00	100,000000	20/07/16	15,806339		100,244445	1.433.495,57	0,06	0,05
TRSAKSN61815	TL	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	27/06/18	13,51	700.000,00	100,000000	30/06/16	15,689588		100,209796	701.468,57	0,03	0,02
TRSGMD71813	TL	GLYHO	13/07/18	14,44	3.090.000,00	100,000000	15/04/16	14,549069		102,995459	3.182.559,69	0,14	0,11
TRSYDAT71814	TL	YDA İNŞAAT	24/07/18	12,60	8.440.000,00	100,000000	24/08/16	12,653112		102,367508	8.639.817,68	0,37	0,30
TRSZORN81814	TL	ZOREN	16/08/18	0,00	2.000.000,00	103,255100	09/02/16	14,974854		101,751742	2.035.034,85	0,09	0,07
TRSCICE1818	TL	İC İÇTAŞ ENERJİ YATIRIM HOLDİNG A.Ş.	12/10/18	12,64	5.250.000,00	100,000000	14/10/16	13,286103		102,744054	5.394.062,84	0,23	0,19
TRSKOTNE1814	TL	KOTON	19/10/18	12,62	8.820.000,00	100,000000	29/11/16	13,266137		102,498078	9.040.330,44	0,39	0,31
TRSRNSH11919	TL	RÖNESANS HOLDİNG	24/01/19	15,26	1.580.000,00	100,000000	27/12/16	13,215303		102,317173	1.616.611,33	0,07	0,06
TRSAKSN61914	TL	AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	26/06/19	14,72	970.000,00	100,000000	29/11/16	15,836819		100,506549	974.913,53	0,04	0,03
TRSBEDS81914	TL	BAŞKENT ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	12/08/19	4,00	10.240.000,00	100,000000	27/10/16	4,052646		104,333134	10.683.712,93	0,46	0,37
TRSBEDS91913	TL	BAŞKENT ELEKTRİK DAĞITIM A.Ş.	27/09/19	4,00	8.000.000,00	100,000000	30/09/16	4,161462		102,116213	8.169.297,03	0,35	0,28
TRSAFKK11910	TL	AKLEASE	13/11/19	0,00	3.400.000,00	102,429500	05/12/16	9,946141		102,218120	3.475.416,09	0,15	0,12
TRSYDAT72010	TL	YDA İNŞAAT	22/07/20	13,54	9.270.000,00	100,000000	26/07/16	13,207793		102,337140	9.486.652,84	0,41	0,33
GRUP TOPLAMI					121.474.750						124.047.390,32	5,37	4,27
GRUP TOPLAMI					125.994.750						128.422.360,65	5,55	4,43
GRUP TOPLAMI					2.337.214.732						2.316.203.425,82	99,98	79,79

AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş.**Gelir Amaçlı Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu (AE2)**
31 Aralık 2016 Tarihli Fiyat Raporu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (%)
T.REPO															
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	7.504.950,00	8,030000	30/12/16		5.998.060,00	7.504.950,00	8,330000	7.503.238,01	4,41	0,26
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	2.501.650,00	8,030000	30/12/16		1.999.355,00	2.501.650,00	8,330000	2.501.079,34	1,47	0,09
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	7.504.950,00	8,030000	30/12/16		5.998.060,00	7.504.950,00	8,330000	7.503.238,01	4,41	0,26
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	2.501.650,00	8,030000	30/12/16		1.999.355,00	2.501.650,00	8,330000	2.501.079,34	1,47	0,09
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	7.504.950,00	8,030000	30/12/16		5.998.060,00	7.504.950,00	8,330000	7.503.238,01	4,41	0,26
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	2.501.650,00	8,030000	30/12/16		1.999.355,00	2.501.650,00	8,330000	2.501.079,34	1,47	0,09
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	7.504.950,00	8,030000	30/12/16		5.998.060,00	7.504.950,00	8,330000	7.503.238,01	4,41	0,26
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	2.501.650,00	8,030000	30/12/16		1.999.355,00	2.501.650,00	8,330000	2.501.079,34	1,47	0,09
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	7.504.950,00	8,030000	30/12/16		5.998.060,00	7.504.950,00	8,330000	7.503.238,01	4,41	0,26
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,04	2.501.652,05	8,040000	30/12/16		1.999.355,00	2.501.652,05	8,330000	2.501.081,39	1,47	0,09
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,04	7.504.956,16	8,040000	30/12/16		5.998.065,00	7.504.956,16	8,330000	7.503.244,17	4,41	0,26
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,04	2.501.652,05	8,040000	30/12/16		1.999.355,00	2.501.652,05	8,330000	2.501.081,39	1,47	0,09
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,04	7.504.956,16	8,040000	30/12/16		5.998.065,00	7.504.956,16	8,330000	7.503.244,17	4,41	0,26
TRT080323T10	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	1.000.661,64	8,050000	30/12/16		1.229.405,00	1.000.661,64	8,330000	1.000.433,37	0,59	0,03
TRT080323T10	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	2.001.323,29	8,050000	30/12/16		2.458.810,00	2.001.323,29	8,330000	2.000.866,76	1,18	0,07
TRT140126T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	5.503.639,04	8,050000	30/12/16		5.517.600,00	5.503.639,04	8,330000	5.502.383,58	3,24	0,19
TRT140126T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	4.502.977,40	8,050000	30/12/16		4.514.400,00	4.502.977,40	8,330000	4.501.950,20	2,65	0,16
TRT140126T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	5.503.639,04	8,050000	30/12/16		5.517.600,00	5.503.639,04	8,330000	5.502.383,58	3,24	0,19
TRT140126T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	4.502.977,40	8,050000	30/12/16		4.514.400,00	4.502.977,40	8,330000	4.501.950,20	2,65	0,16
TRT140126T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	1.000.661,64	8,050000	30/12/16		1.003.200,00	1.000.661,64	8,330000	1.000.433,37	0,59	0,03
TRT140126T11	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	9.005.954,79	8,050000	30/12/16		9.028.800,00	9.005.954,79	8,330000	9.003.900,40	5,29	0,31
TRT190521T17	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	10.006.600,00	8,030000	30/12/16		11.202.340,00	10.006.600,00	8,330000	10.004.317,34	5,89	0,34
TRT190521T17	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	10.006.600,00	8,030000	30/12/16		11.202.340,00	10.006.600,00	8,330000	10.004.317,34	5,89	0,34
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	2.501.650,00	8,030000	30/12/16		1.823.430,00	2.501.650,00	8,330000	2.501.079,34	1,47	0,09
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	7.504.950,00	8,030000	30/12/16		5.470.300,00	7.504.950,00	8,330000	7.503.238,01	4,41	0,26
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	2.501.650,00	8,030000	30/12/16		1.823.430,00	2.501.650,00	8,330000	2.501.079,34	1,47	0,09
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	3.502.310,00	8,030000	30/12/16		2.552.805,00	3.502.310,00	8,330000	3.501.511,07	2,06	0,12
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	6.504.290,00	8,030000	30/12/16		4.740.925,00	6.504.290,00	8,330000	6.502.806,27	3,82	0,22
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	3.502.310,00	8,030000	30/12/16		2.552.805,00	3.502.310,00	8,330000	3.501.511,07	2,06	0,12
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,03	6.504.290,00	8,030000	30/12/16		4.740.925,00	6.504.290,00	8,330000	6.502.806,27	3,82	0,22
TRT230222T13	TL	HAZİNE	02/01/17		8,04	8.005.286,58	8,040000	30/12/16		5.834.985,00	8.005.286,58	8,330000	8.003.460,45	4,71	0,28
TRT240724T15	TL	HAZİNE	02/01/17		8,05	9.005.954,79	8,050000	30/12/16		10.003.060,00	9.005.954,79	8,330000	9.003.900,40	5,29	0,31
GRUP TOPLAMI						170.112.292							170.073.489	100,00	5,89

AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş.**Gelir Amaçlı Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu (AE2)**
31 Aralık 2016 Tarihli Fiyat Raporu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (%)
MEVDUAT															
AKBANK T.A.S.	TL		02/02/17		11,40	140.000.000,00		19/12/16			141.967.671,23	11,400000	140.569.405,68	33,74	4,84
HALK BANKASI	TL		02/02/17		11,00	85.000.000,00		19/12/16			86.149.590,16	11,000000	85.330.519,03	20,48	2,94
T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	TL		02/02/17		10,95	90.000.000,00		19/12/16			91.211.680,33	10,950000	90.348.378,13	21,69	3,11
TC ZIRAAT BANKASI	TL		02/02/17		10,95	100.000.000,00		19/12/16			101.346.311,50	10,950000	100.387.086,83	24,09	3,46
GRUP TOPLAMI						415.000.000							416.635.389,67	100,00	14,35
GRUP TOPLAMI						415.000.000							416.635.389,67	100,00	14,35

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (%)
BPP															
BPP			02/01/17		10,30	320.270,90	10,300000	30/12/16			320.270,90	9,640000	320.186,36	10,09	0,01
BPP			02/01/17		10,30	1.851.566,16	10,300000	30/12/16			1.851.566,16	9,640000	1.851.077,40	58,36	0,06
BPP			02/01/17		10,30	1.000.846,58	10,300000	30/12/16			1.000.846,58	9,640000	1.000.582,39	31,55	0,03
GRUP TOPLAMI						3.172.684							3.171.846,15	100,00	0,10

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (%)
KİRA SERTİFİKALARI															
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları															
TRD160817T11	TL	HAZİNE	16/08/17		9,96	340.000,00	100,000000	29/01/16	9,687920			104,036657	353.724,63	0,02	0,01
GRUP TOPLAMI						340.000							353.724,63	0,02	0,01
GRUP TOPLAMI						340.000							353.724,63	0,02	0,01
FON PORTFÖY DEĞERİ													2.906.437.873		100,00

AvivaSA Emeklilik ve Hayat A.Ş.

Gelir Amaçlı Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu (AE2)
31 Aralık 2016 Tarihli Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

	31 Aralık 2016			31 Aralık 2015		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
Fon portföy değeri	2.906.437.873	-	100,12	2.638.617.225	-	103,76
Hazır değerler	118.664	-	-	71.752	-	-
Kasa	-	-	-	-	-	-
Bankalar	118.664	100,00	-	71.752	100,00	-
Diğer hazır değerler	-	-	-	-	-	-
Alacaklar	1.292.149	-	0,04	942.613	-	0,04
Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
Diğer Alacaklar	1.292.149	-	-	942.613	100,00	-
Borçlar	(4.764.708)	-	-0,16	(96.561.981)	-	(3,80)
Takasa Borçlar	-	-	-	-	-	-
Banka kredileri	-	-	-	-	-	-
Fon yönetim ücretleri	(4.660.641)	(97,82)	-	(4.086.584)	(4,23)	-
Diğer borçlar	(104.067)	(2,18)	-	(92.354.615)	(95,64)	-
Fon toplam değeri	2.903.083.978		100,00	2.543.069.609		100,00