

ANADOLU HAYAT EMEKLİLİK A.Ş. PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU' NA AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ Halka arz tarihi: 27/10/2003		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
01.07.2019 tarihi itibarıyla		Yatırım Stratejisi	Portföy Yöneticileri
Net Varlık Değeri	1.327.560.616	Fon para piyasası fonudur. Portföyün tamamı devamlı olarak vadesine en fazla 184 gün kalmış likiditesi yüksek para ve sermayesi araçlarından oluşur ve fon portföyünün günlük olarak hesaplanan ağırlıklı ortalama vadesi en fazla 45 gündür. Fon portföyü ağırlıklı olarak ters repo dahil kısa vadeli ve likiditesi yüksek kamu iç borçlanma araçları ile özel sektör borçlanma araçlarından oluşmaktadır. Fon portföyü düşük risk düzeyiyle yönetilmektedir. Ters repo, kısa vadeli Hazine Bonoları'nın ve özel sektör borçlanma araçlarının getirilerinden faydalanılmaktadır. Bunlara ek olarak fon izahnamesinin 2.4. maddesindeki tabloda yer alan para ve sermaye piyasası araçlarına, belirlenen sınırlar çerçevesinde yatırım yapılır. Fon portföyüne vadeye kalan gün sayısı hesaplanamayan varlıklar dahil edilemez Fonun karşılaştırma ölçütü %60 BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi + %30 BIST-KYD DİBS 91 Gün Endeksi + %5 BIST-KYD ÖSBA Sabit Endeksi + %5 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi'dir.	Ali Emrah Yücel İş Portföy Yönetimi A.Ş. Genel Müdür Yrd.
Birim Pay Değeri	0,058765		Doruk Ergun İş Portföy Yönetimi A.Ş. Müdür
Yatırımcı Sayısı	157.149	Yatırım Riskleri	
Tedavül Oranı	%22,59	Fon, piyasa riski, karşı taraf riski, likidite riski, operasyonel risk, yoğunlaşma riski, korelasyon riski, yasal risk, ihraççı riski ve kaldıraç yaratan işlem riskini taşımaktadır.	
Portföy Dağılımı			
-Türk Özel Sektör Borçlanma Araçları	%0,56		
-Ters Repo	%79,60		
-Kamu İç Borçlanma Araçları	%19,84		En Az Alınabilir Pay Adeti: 0,001 Adet

B. PERFORMANS BİLGİSİ

PERFORMANS BİLGİSİ								
YILLAR	Toplam Getiri* (%)	Fon Brüt Getirisi (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi (%)	Enflasyon Oranı (%)	Fon Getirisinin Zaman İçinde Standart Sapması (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%)	Bilgi Rasyosu ***	Sunuma Dahil Dönem Sonu Fon Net Varlık Değeri (TL)
2019	12,03	12,57	11,91	8,09 (**)	0,06	0,04	0,02	1.327.560.616
2018	18,68	19,76	17,65	33,64	0,05	0,04	0,10	1.118.772.645
2017	11,86	12,95	11,32	15,47	0,03	0,02	0,11	845.305.068
2016	9,65	10,74	9,47	9,94	0,02	0,02	0,04	679.079.020
2015	9,68	10,77	10,01	5,71	0,02	0,02	0,08	399.080.972
2014	3,24 (a) 5,30 (b)	3,65 (a) 5,99 (b)	3,57 (a) 5,63 (b)	5,06 (a) 1,24 (b)	0,02	0,02	3,60	243.801.046
2013	5,13	-	6,03	6,97	0,02	0,02	-	138.579.026

(*):Portföyün geçmiş performansı gelecek dönem performansı için bir gösterge olamaz.

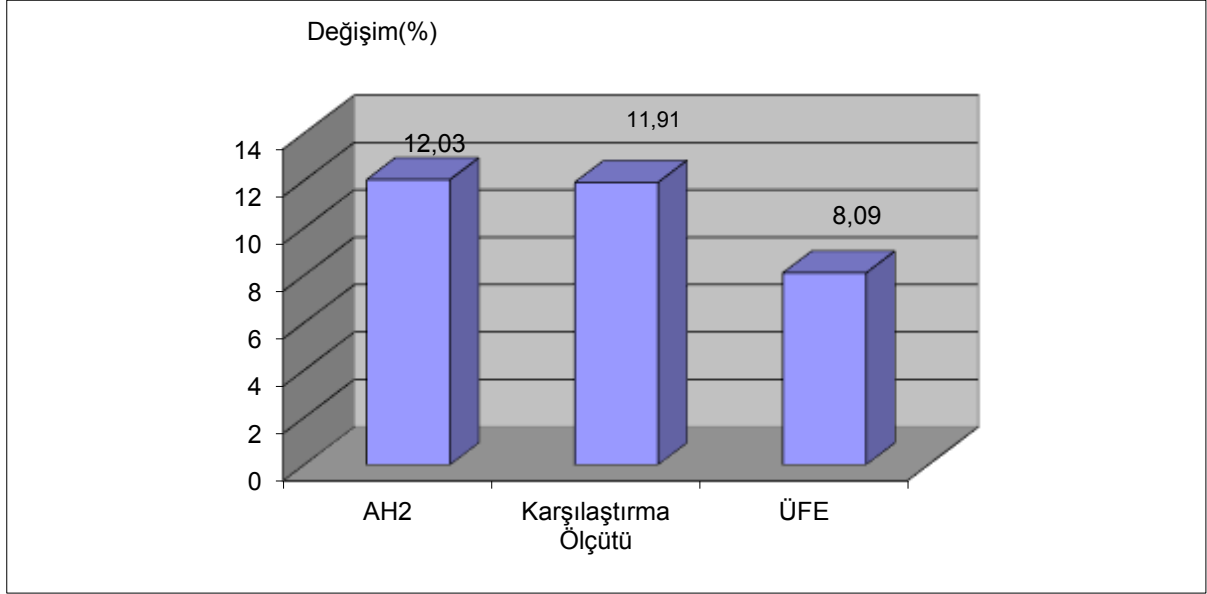
(**):Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan 6 aylık ÜFE oranıdır.

(***):Performans sunumlarında riske göre düzeltilmiş getirinin hesaplanmasında "Bilgi Rasyosu" (Information Ratio) kullanılacaktır. Bilgi rasyosu, Sermaye Piyasası Kurulu'nun 17/12/2013 tarih ve 28854 sayılı "Performans Sunuş Tebliği" nde belirtildiği şekilde hesaplanmaktadır.

(a) 31.12.2013-15.05.2014 tarihleri arası getiridir.

(b)15.05.2014-31.12.2014 tarihleri arası getiridir.

GRAFİK



*(31.12.2018-30.06.2019)

(**):Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan 6 aylık ÜFE oranıdır.

GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.

C. DİPNOTLAR

1. Şirketin faaliyet kapsamı:

Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanunu, Sigortacılık Kanunu, Türk Ticaret kanunu ve Sermaye Piyasası Kanunu ile diğer ilgili tüm mevzuatlarda öngörülen esas ve kurallara uygun hareket etmek kaydıyla, hayat grubu sigortaları, kaza sigortaları, hastalık sigortaları gibi mevzuatın izin verdiği tüm sigortacılık ve reasürans işlemlerini yürütmek, bireysel emeklilik faaliyetlerinde bulunmak, bu konulara ilişkin aracılık hizmeti almaktır. Şirket ayrıca; Emeklilik fonlarına yönelik mevzuatta belirlenen yükümlülüklerini yerine getirmek kaydıyla, emeklilik yatırım fonu kurmak, işletmek, birleştirmek, devretmek ve iştirak etmek gibi hususlarda tasarrufta bulunabilir.

2. Nispi Getiri = [Gerçekleşen Getiri- Gerçekleşen Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi]

$$(\%12,03 - \%11,91) = \%0,12$$

3. Aşağıda 01.01.2019-30.06.2019 dönemine ait faaliyet giderlerinin ortalama net varlık değerine oranı yer almaktadır.

AH2 Fon Gider Bilgileri	Dönem İçi Ortalama Fon Toplam Değerine Oranı (%)
İhraç İzni Giderleri	0,000000%
Tescil ve İlan Giderleri	0,000451%
Sigorta Giderleri	0,000000%
Noter Ücretleri	0,000000%
Bağımsız Denetim Ücreti	0,000761%
Alınan Kredi Faizleri	0,000000%
Saklama Ücretleri	0,013947%
Fon Yönetim Ücreti	0,497751%
Hisse Senedi Komisyonu	0,000000%
Tahvil Bono Komisyonu	0,000540%
Gecelik Ters Repo Komisyonu	0,064670%
Vadeli Ters Repo Komisyonu	0,004662%
TPP Komisyonu	0,000804%
Yabancı Menkul Kıymet Komisyonu	0,000000%
Vergi ve Diğer Giderler	0,000000%
Türev Araçları Komisyonu	0,000000%
Merkezi Kayıt Kuruluşu A.Ş. Komisyonları	0,000000%
Diğer Giderler	0,010823%
TOPLAM GİDERLER	0,594409%

4. 01.01.2019-30.06.2019 tarihleri arasında fonun karşılaştırma ölçütü %60 BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi + %30 BIST-KYD DİBS 91 Gün Endeksi + %5 BIST-KYD ÖSBA Sabit Endeksi + %5 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi'dir.
5. Emeklilik yatırım fonlarının portföy işletmeciliğinden doğan kazançları kurumlar vergisi ve stopajdan muaftır
6. Fon Gider Bilgileri:

01.01.2019-30.06.2019 Dönemi Anadolu Hayat Emeklilik A.Ş. Emeklilik Yatırım Fonları Fon Toplam Gider Kesintisi							
Fon Kodu	Fon İşletme Adı	* Azami Fon Toplam Gider Kesintisi Oranı (%)	** Gerçekleşen Fon İşletim Gider Kesintisi Oranı (%)	*** Gerçekleşen Diğer Fon Giderlerinin Oranı (%)	**** Gerçekleşen Fon Toplam Gider Kesintisi Oranı (%)	Ortalama Fon Net Varlık Değeri (TL)	Fon Toplam Gider Kesintisi Aşım Tutarı (TL)
AH2	AHE Para Piyasası Fonu	0,540521	0,497751	0,096659	0,594409	1.213.837.810,00	654.124,15

* Bireysel Emeklilik Sistemi Hakkında Yönetmeliğin II numaralı ekinde belirtilen, fon türlerine göre fondan yıl içerisinde kesilebilecek en fazla gider oranlarının rapor tarihine denk gelen karşılığını ifade etmektedir.

** Dönem içerisinde gerçekleşen fon işletim gideri kesintisi tutarının, ortalama fon net varlık değerine oranını ifade etmektedir.

*** Fona ilişkin bağımsız denetim gideri, saklama gideri, aracılık komisyonları, vb. giderlerin ortalama fon net varlık değerine oranını ifade etmektedir.

**** Dönem içerisinde gerçekleşen fon işletim gideri kesintisi tutarları ve fona ilişkin diğer giderlerin tutarlarının, ortalama fon net varlık değerine oranını ifade etmektedir.