

ANADOLU HAYAT EMEKLİLİK A.Ş. HİSSE SENEDİ GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU'NA AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ Halka arz tarihi:27/08/2004		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
01.07.2019 tarihi itibarıyla		Yatırım Stratejisi	Portföy Yöneticileri
Net Varlık Değeri	66.496.171	Fon, Emeklilik Yatırım Fonlarının Kuruluş ve Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Yönetmeliğin 6. maddesinde belirtilen, fon paylarının Bireysel Emeklilik Sistemi Hakkında Yönetmelik çerçevesinde kurulan grup emeklilik planları ve sözleşmeleri kapsamında yer alan belirli kişi ya da kuruluşlara tahsis edilmesi amacıyla kurulmuş grup emeklilik yatırım fonudur. Fon portföyünün en az %80'i devamlı olarak BIST'te işlem gören paylardan oluşur. Fon, ulusal pay piyasasındaki dalgalanmalardan maksimum şekilde yararlanmayı planlamaktadır. Fon portföyüne likiditesi fazla, piyasa değeri yüksek, sektöründe geleceği olan şirketlerin payları alınıp-satılarak sermaye kazancı elde edilmesi amaçlanmaktadır. Fon pay yatırımlarına bağlı olarak makro ekonomik risk, sektör riski, firma riski ve likidite riski taşımaktadır. Pay piyasasındaki değişimler fonun getirisini etkilemektedir. Fon yönetiminde risklerden korunmak amacıyla çeşitlendirme yapılmakta, riskler dağıtılarak asgariye indirilmektedir. Bunlara ek olarak fon izahnamesinin 2.4. maddesindeki tabloda yer alan para ve sermaye piyasası araçlarına, belirlenen sınırlar çerçevesinde yatırım yapılır. Fonun karşılaştırma ölçütü %90 BIST 100 Getiri Endeksi + %10 BIST-KYD REPO (Brüt) Endeksi'dir.	Emin Yiğit Onat HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. Portföy Yöneticisi
Birim Pay Değeri	0,085598		Murat İğnebekçili HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. Portföy Yöneticisi
Yatırımcı Sayısı	10.280	Yatırım Riskleri	
Tedavül Oranı	%0,78	Fon, piyasa riski, karşı taraf riski, likidite riski, kaldıraç yaratan işlem riski, operasyonel risk, yoğunlaşma riski, korelasyon riski, yasal risk, ihraççı riski, baz riski, teminat riski, opsiyon duyarlılık riskleri ve yapılandırılmış borçlanma araçları riskini taşımaktadır.	
Portföy Dağılımı			
-Ulusal Paylar	%93,21		
-Takasbank Para Piyasası	% 0,18		
-Ters Repo	%3,76		
-VIOP Nakit Teminat	%0,92		
-Yatırım Fonu	%1,93		

Ulusal Payların Sektörel Dağılımı			
-Sınai	%23,36		
-Mali Kuruluşlar	%30,50		
-Hizmet	%34,07		
-Teknoloji	%11,50		
-Diğer	%0,57		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	13,50	14,07	9,27	8,09 (**)	1,25	1,31	0,12	66.496.171
2018	-9,50	-8,34	-13,06	33,64	1,30	1,30	0,09	69.747.220
2017	54,29	55,47	45,03	15,47	0,89	0,94	0,15	71.161.115
2016	12,08	13,20	9,27	9,94	1,21	1,20	0,05	55.063.921
2015	1,32 (a) -12,91 (b)	1,49 (a) -11,92 (b)	-0,09 (a) -14,84 (b)	5,71	1,31	1,31	0,08	51.138.246

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

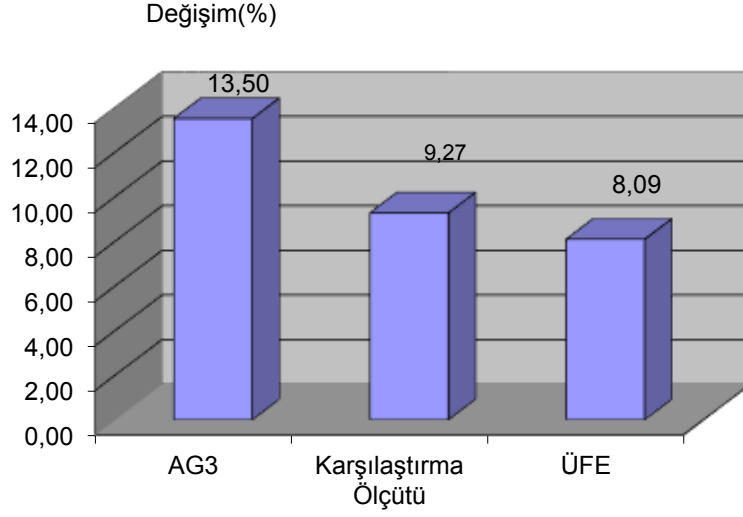
(**):Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan 6 aylık ÜFE oranıdır.

(***):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) 31.12.2014-16.02.2015 tarihleri arası getiridir.

(b) 16.02.2015-31.12.2015 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] =
(%13,50) - (%9,27)= %4,23

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

AG3 Fon Gider Bilgileri	Dönem İçi Ortalama Fon Toplam Değerine Oranı (%)
İhraç İzni Giderleri	0,000000%
Tescil ve İlan Giderleri	0,002383%
Sigorta Giderleri	0,000000%
Noter Ücretleri	0,000000%
Bağımsız Denetim Ücreti	0,007586%
Alınan Kredi Faizleri	0,000000%
Saklama Ücretleri	0,006385%
Fon Yönetim Ücreti	0,497750%
Hisse Senedi Komisyonu	0,034185%
Tahvil Bono Komisyonu	0,000000%
Gecelik Ters Repo Komisyonu	0,004245%
Vadeli Ters Repo Komisyonu	0,000000%
TPP Komisyonu	0,001007%
Yabancı Menkul Kıymet Komisyonu	0,000000%
Vergi ve Diğer Giderler	0,000000%
Türev Araçları Komisyonu	0,001895%
Merkezi Kayıt Kuruluşu A.Ş. Komisyonları	0,000000%
Diğer Giderler	0,017937%
TOPLAM GİDERLER	0,573373%

4. 02.01.2019-30.06.2019 tarihleri arasında fonun karşılaştırma ölçütü %90 BIST 100 Getiri Endeksi + %10 BIST-KYD REPO (Brüt) 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)
AG3	AHE Grup Hisse Fonu	1,130630	0,497750	0,075623	0,573373	66.854.281,16	0,00

* 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, v.b. 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.