

**01.01.2019– 31.12.2019 DÖNEMİNE İLİŞKİN
ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
İKİNCİ KAMU DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU**

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi /Kayıt Belge No	17.10.2003-EYF.39-1/1237
İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	09.09.2003 – 24328-2003
Halka Arz Tarihi	27.10.2003
Fon Tutarı ve Pay Sayısı	100.000.000.- TL (Yüzmllyon TL) 10.000.000.000.- (Onmilyar) pay
Fon'un Türü	Borçlanma Araçları Fonu
Portföy Yönetim Şirketi	Yapı Kredi Portföy Yönetimi A.Ş.
Fon Kurulu Başkanı	Ersin Pak
Fon Kurulu Üyeleri	Taylan Türkölmez Burcu Uzunoğlu
Fon Denetçisi	F.Azade Onan
Fon Müdürü	İsmi Durmuş
Web Adresi	https://www.allianz.com.tr/tr_TR.html
Telefon No /Faks No	(0216) 556 66 66 - (0216) 556 99 79

Piyasa Değerlendirmesi

Yıllık raporun "BÖLÜM A: 01.01.2019-31.12.2019 DÖNEMİNİN DEĞERLENDİRİLMESİ " başlığı altında yer almaktadır.

Fon Performansları ve Yatırım Politikaları

Fon performans bilgileri ve dönem içindeki yatırım politikalarına ilişkin değişikliklere "Performans Sunum Raporu"ndan ulaşabilirsiniz.

Fonun İçtüzük, İzahname ve Tanıtım Formu Değişiklikleri

Fonun ilgili dönem içerisinde yapılan tüm değişikliklerine https://www.allianz.com.tr/tr_TR/urunler/bireysel-emeklilik/fon-bilgileri.html Internet sitemizde fonların sürekli bilgilendirme formu bölümünden veya Kamuyu Aydınlatma Platformunun <https://www.kap.org.tr/tr/YatirimFonlari/EYF> Internet adresinden ulaşabilirsiniz.

Faaliyet dönemi içerisinde fon kurulu tarafından olağan toplantılar gerçekleştirilmiştir. Bu toplantılarda genel piyasalar, fonun performansı ve fonla ilgili aşağıdaki başlıklarda belirtilen değişiklikler görüşülmüştür:

- 1- Fonun iç kontrol ve risk yönetimine ilişkin fon denetçisi raporunun fon kuruluna sunulmasına ilişkin 22.03.2019 tarihli karar,
- 2- İzahname değişikliğine ilişkin 21.06.2019 tarihli karar; Geçici fon olarak kullanılan Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Emanet Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu yerine Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu' nun kullanılabilmesi amacıyla Sermaye Piyasası Kurulu' na başvuruda bulunulmuştur. Kurul'un 09.10.2019 tarih ve E.12818 sayılı izin yazısı ile onaylanan izahname değişikliği 02.12.2019 tarihi itibarıyla geçerli olmuştur.
- 3- Fon'un risk yönetimi prosedürünün güncellenmesine ilişkin 23.12.2019 tarihli karar,

Fonun Risk Yönetimi

Fon portföy yöneticisinin Risk Yönetimi Birimi günlük risk ölçümlerini Risk Yönetimi Prosedürüne uygun olarak yapmakta ve sonuçlarını Fon Kurulu üyeleri ile paylaşmaktadır.


Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Başkanı)


Burcu Uzunoğlu
Direktör (Mali İşler)
(Fon Kurulu Üyesi)

AUG - Allianz Hayat ve Emeklilik İKİNCİ Kamu Dış Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu

31 Aralık 2019 TARİHİ İTİBARIYLA FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Diğer - Teminat	1.749.819,23	1.749.819,23	0,81
Euro Tahvil (Kamu) - EUR	24.989.000,00	179.596.204,44	83,34
Euro Tahvil (Kamu) - USD	1.500.000,00	9.098.951,40	4,22
Özel Sektör Borçlanma Araçları	900.000,00	927.801,00	0,43
Takasbank Para Piyasası	2.070.218,73	2.070.218,73	0,96
Ters Repo	20.012.328,77	20.012.328,77	9,29
Yatırım Fonu Katılma Payları	7.024.691,00	2.042.435,93	0,95
Fon Portföy Değeri		215.497.759,50	100,00



Portföydeki varlıkların dağılımı aşağıdaki gibidir:

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Diğer - Teminat		1.749.819,23	0,81
VIOP NAKİT TEMİNAT	1.749.819,23	1.749.819,23	0,81
Euro Tahvil (Kamu) - EUR		179.596.204,44	83,34
XS0903454166	5.790.000,00	40.511.687,47	18,80
XS0993155398	3.562.000,00	25.198.956,02	11,69
XS1057340009	3.200.000,00	23.240.602,61	10,78
XS1629918415	2.416.000,00	16.371.512,76	7,60
XS1843443356	5.150.000,00	37.567.531,93	17,43
XS1909184753	4.871.000,00	36.705.913,65	17,03
Euro Tahvil (Kamu) - USD		9.098.951,40	4,22
US900123AX87	1.400.000,00	8.523.692,10	3,96
US900123CK49	100.000,00	575.259,30	0,27
Özel Sektör Borçlanma Araçları		927.801,00	0,43
YAPI VE KREDİ BANKASI	900.000,00	927.801,00	0,43
Takasbank Para Piyasası		2.070.218,73	0,96
Ters Repo		20.012.328,77	9,29
Yatırım Fonu Katılma Payları		2.042.435,93	0,95
Yatırı Kredi Portföy Para Piyasası Fonu	7.024.691,00	2.042.435,93	0,95
Toplam		215.497.759,50	100,00

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

	Tutar	%
Fon portföy değeri	215.497.759,50	100,42
Hazır değerler	8.276,49	0,00
Alacaklar	112.145,36	0,05
Borçlar	-1.022.211,44	-0,48
Net varlık değeri	214.595.969,91	100,00

Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş.