

METLIFE EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP
EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(MHG)
FAALİYET RAPORU
30.06.2021

I - Fon Bilgileri

İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi : 09 Temmuz 2009

İzahname Ticaret Sicili Tescil Tarihi : 05.11.2009

Halka Arz Tarihi : 18.11.2009

Fon'un Türü : Borçlanma Araçları Fonu

Faaliyeti : Portföy İşletmeciliği

Kayda Alınmış Nominal Fon Tutarı : 2.000.000.000 -TL

Risk Grubu : Orta

Portföy Yöneticisi : Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.

Fon Kurulu Üyeleri	: Fon Kurulu Başkanı	Raif Deniz YURTSEVEN
	Üye	Rengin UTKU
	Üye	Mutlu ÖZCAN
	Üye	Özlem ÇAYDAŞI
	Üye	Bahadır Gebece

Fon Müdürü : Mutlu ÖZCAN

Fon Denetçisi : Orhan İnan, Selim Baloğlu

Telefon No / Faks No : 0.216.538.91.00 / 0.216.538.94.98

E-mail Adresi :finansmanvefonyonetimi@metlife.com.tr

Web Adresi :www.metlife.com.tr

Tanım

Emeklilik Yatırım Fonu, Emeklilik Şirketleri tarafından emeklilik sözleşmesi çerçevesinde alınan ve katılımcılar adına bireysel emeklilik hesaplarında izlenen katkıların, riskin dağıtılması ve inancılı mülkiyet esaslarına göre işletilmesi amacıyla oluşturulan malvarlığıdır. Süresiz olarak kurulan fonun tüzel kişiliği yoktur. Fon, MetLife Emeklilik ve Hayat A.Ş. emeklilik planları kapsamında katılımcılara sunulur.

Fonun Amacı

Fon, Yönetmeliğin 6.maddesi çerçevesinde, fon paylarının belirli kişi ya da kuruluşlara tahsis edilmesi amacıyla kurulmuş bir grup emeklilik yatırım fonudur. Fon'un yatırım stratejisi, devamlı olarak portföyünün en az %80'ini kamu borçlanma araçlarına ve kamu borçlanma araçlarının konu olduğu ters repoya yatırmak suretiyle gelir elde etmektir.

Yatırım Stratejisi

Fon yönetiminde ilgili Yönetmelik hükümleri saklı kalmak üzere aşağıdaki sınırlamalara uyulur.

VARLIK TÜRÜ	EN AZ %	EN ÇOK %
Kamu ve Özel Sektör Borçlanma Araçları ile Kamu Borçlanma Araçlarının Konu Olduğu Ters Repo İşlemleri (Türk Lirası cinsinden)	80	100
Yabancı Kamu ve Özel Sektör Borçlanma Araçları	0	20
Ters Repo	0	10
Takasbank Para Piyasası ve Yurtiçi Organize Para Piyasası İşlemleri	0	10
Yerli Ortaklık Payları	0	10
Vadeli Mevduat (TL/Döviz) / Katılma Hesabı (TL/Döviz)	0	20
Altın ve Diğer Kıymetli Madenler ve Bu Madenlere Dayalı Sermaye Piyasası Araçları	0	20
Yatırım fonu katılma payları, yabancı yatırım fonu payları, borsa yatırım fonu katılma payları, gayrimenkul yatırım fonu katılma payları, girişim sermayesi yatırım fonu katılma payları ve yatırım ortaklığı payları	0	20
Gelir Ortaklığı Senetleri	0	20
Kira Sertifikaları (Kamu/Özel)	0	20
İpotek ve/veya Varlığa Dayalı Menkul Kıymetler	0	20
Aracı Kuruluş ve Ortaklık Varantları/Sertifikalar	0	15
Yapılandırılmış Yatırım Araçları	0	10

Fon, Yönetmeliğin 6. maddesi çerçevesinde, fon paylarının belirli kişi ya da kuruluşlara tahsis edilmesi amacıyla kurulmuş bir grup emeklilik yatırım fonudur. Fon'un yatırım stratejisi, devamlı olarak portföyünün en az %80'ini kamu ve özel sektör borçlanma araçlarına ve kamu borçlanma araçlarının konu olduğu ters repoya yatırmak suretiyle gelir elde etmektir. Fonun risk yapısının kontrolü amacıyla fon portföyüne dahil edilen yatırım araçları arasında çeşitlendirmeye gidilir. Piyasa koşullarına bağlı olarak %20'yi aşmamak üzere altın ve kıymetli madenlere dayalı sermaye piyasası araçları, gelir ortaklığı senetleri, ipotek ve/veya varlığa dayalı menkul kıymetler ile vadeli/vadesiz mevduat/katılma hesapları, yatırım fonu katılma paylarına ve %10'u aşmamak üzere Takasbank Para Piyasası ve Yurtiçi Organize Para Piyasası İşlemleri, ters repo ve BIST-100 endeksindeki paylara yatırım yapılarak fonun getiri ve risk oranı kontrol altında tutulacaktır. Fon, portföyüne tüm vadelerdeki borçlanma senetlerini dahil edebilir. Piyasalarda oluşabilecek fırsatlardan faydalanmak amacıyla fon portföyünde bulunan yatırım araçları üzerinden alım satım işlemleri yapılabilir. Fon yönetimi sırasında yatırım yapılacak sermaye piyasası araçlarının seçiminde nakde dönüşümü kolay ve riski az olanlar tercih edilir.

Fon'un karşılaştırma ölçütü aşağıdaki gibi hesaplanır.

- + %75 BIST-KYD DİBS Tüm Endeksi
- + %10 BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi
- + %10 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi
- + %5 BIST-KYD Özel Sektör Borçlanma Araçları Sabit Endeksi

Fon Kuruluş Bilgileri

Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 02.07.2009 tarih, B.02.1.SPK.0.15.548 sayılı izinle kuruluşuna izin verilen Fon'un içtüzüğü 09.07.2009 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından 129882-2009 sayı ile tescil edilmiş olup 14.07.2009 tarih, 7353 sayılı Ticaret Sicili Gazetesi'nde ilan edilmiştir.

02.11.2009 tarihinde Sermaye Piyasası tarafından EYF 128 / 912 sayılı belge ile kayda alınan Fon, Beykoz Vergi Dairesi'nin mükellefidir.

Katılımcıları bilgilendirme amaçlı fon izahnamesi 05 Kasım 2009 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından tescil edilmiş ve 10 Kasım 2009 tarih, 7435 sayılı Türkiye Ticaret Sicili Gazetesinde ilan edilmiştir. 18 Kasım 2009 tarihinden itibaren MetLife Emeklilik ve Hayat A.Ş. emeklilik planları içerisinde katılımcılara sunulmaya başlanmıştır.

Dönem İçinde Meydana Gelen Değişiklikler

Fon'un 2021 yılı bağımsız denetim işlemlerinin yapılması için, aşağıda iletişim bilgileri belirtilen DRT Bağımsız Denetim ve SMMM A.Ş. firması ile anlaşma yapılmıştır.

Merkez Adresi : Deloitte Values House, No:1
34398 Maslak, İstanbul
Telefon No : 0.212.366 60 00
İnternet Adresi : www.deloitte.com.tr

Döneme Ait Fon İşlemleri

2021 yılı ilk yarısında fon portföyünün aylık bazda ortalama varlık dağılımı aşağıdaki gibi gerçekleşmiştir.

DÖNEM	KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI	ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI	MEVDUAT	TERS REPO	TAKASBANK PARA PIYASASI	HİSSE SENEDİ	YATIRIM FONLARI
OCAK	86.05%	8.16%		4.77%	0.29%		0.73%
ŞUBAT	89.08%	8.19%		2.21%	0.52%		
MART	81.16%	6.78%	6.74%	4.66%	0.65%	0.01%	
NİSAN	78.37%	5.84%	8.27%	6.70%	0.62%	0.20%	
MAYIS	76.12%	8.01%	8.81%	4.61%	0.66%	1.78%	
HAZİRAN	75.36%	11.48%	9.19%	2.46%	0.59%	0.91%	

Fon'un tahvil/bono ve repo işlemleri Deniz Yatırım Menkul Kıymetler A.Ş. aracılığı ile yapılmıştır. Fon'a ait kıymetler Takasbank'daki fon deposunda saklanmaktadır. Fon nakdi ve nakit hareketleri Deniz Yatırım A.Ş. Genel Müdürlük ve Denizbank A.Ş. Zincirlikuyu Şubesi'ndeki fon hesaplarında izlenmektedir.

Fon'un nakit ve varlık takas işlemleri MetLife Emeklilik ve Hayat A.Ş. Fon Operasyon Birimi, Denizbank ve Deniz Yatırım Menkul Değerler A.Ş. koordinasyonunda Takasbank uzaktan erişim sistemi, Denizbank Nakit Yönetimi Sistemi ve yazılı talimatlar aracılığıyla gerçekleştirilmektedir.

Fon fiyatı, portföy yapısı ve fon performansı ile ilgili bilgiler www.metlife.com.tr sitesinde hergün yayınlanmaktadır.

Fonun Performansına İlişkin Bilgiler

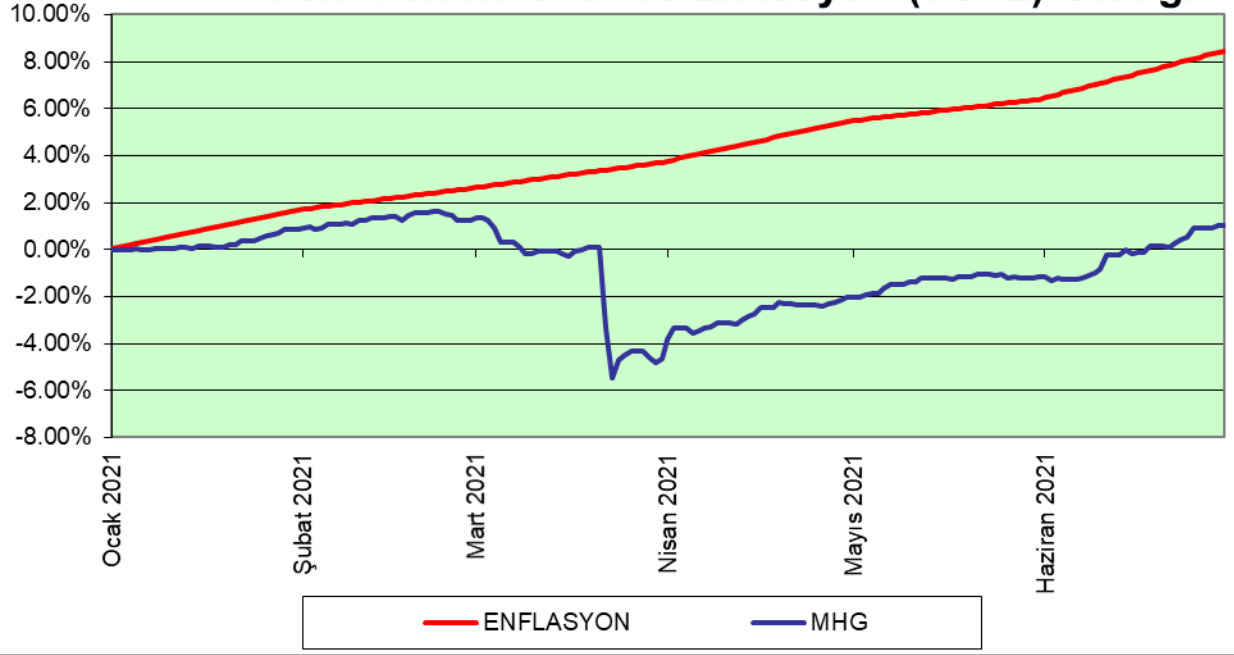
Fon portföyü, 17 Temmuz 2009 tarihinde Kurucu tarafından tahsis edilen 10.000 TL avans ile oluşturulmuş olup Fon'un benchmarkına uygun portföy yapısına 14.08.2009 tarihinde geçilmiştir. Fon 18.11.2009 tarihinde halka arz edilmiştir.

31.12.2020 - 30.06.2021 döneminde;

Fon'un Birim Pay Fiyatı %1,00 Fon'un Karşılaştırma Ölçütü %1,93

performans göstermiştir.

Fon Performansı ve Enflasyon (TÜFE) Grafiği



Raif Deniz YURTSEVEN
Fon Kurulu Başkanı

Rengin UTKU
Fon Kurulu Üyesi

Mutlu ÖZCAN
Fon Kurulu Üyesi

Özlem Çaydaşı
Fon Kurulu Üyesi

Bahadır Gebece
Fon Kurulu Üyesi