

01.01.2019 – 31.12.2019 DÖNEMİNE İLİŞKİN
ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
BİST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi /Kayıt Belge No	30.12.2011 – EYF. 160 / 1125
İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	20.10.2011 - 313152-2011
Halka Arz Tarihi	01.03.2012
Fon Tutarı ve Pay Sayısı	1.000.000.000.- TL (Birmilyartürkİlİrası)TL ve 100.000.000.000.- (Yüzmilyar) pay
Fon'un Türü	Endeks Fon
Portföy Yönetim Şirketi	Ak Portföy Yönetimi A.Ş.
Fon Kurulu Başkanı	Taylan Türkölmez
Fon Kurulu Üyeleri	Ersin Pak Burcu Uzunoğlu Emrah Ayrancı
Fon Denetçisi	F.Azade Onan
Fon Müdürü	Gönül Mutlu
Web Adresi	www.allianz.com.tr
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 Platformu'nun <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 görülmüştür:

1. Fonun hazır değerler kaleminde oluşan nakit fazlası ile ilgili fon kurulu bilgilendirilmiştir. (Karar tarihi : 01 Şubat 2019)

2. Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. BIST Temettü Endeksi Emeklilik Yatırım Fonu'nun Portföy Yöneticisi HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. yerine Ak Portföy Yönetimi A.Ş.; Fon Kurulu Üyesi Nilgün Şimşek Ata' nın yerine Emrah Ayrancı olarak belirlenmiştir. Bu doğrultuda fon kurulu, İçtüzük, İzahname ve tanıtım formu değişiklikleri için Sermaye Piyasası Kurulu' na başvuru yapılmasına karar vermiştir. Değişiklikler, Sermaye Piyasası Kurulu'ndan ("SPK") onay alınmasını müteakiben, 02.05.2019 tarihinden itibaren:

- Fon hesap operatörü HSBC Yatırım Menkul Değerler A.Ş. yerine Akbank T.A.Ş. olarak değiştirilmiştir.
- Fon müdürü Sevda Arslan yerine Gönül Mutlu olarak değiştirilmiştir.

(Karar tarihi : 01 Mart 2019)

3. Fonun portföy yönetim şirketinin 02.05.2019 tarihi itibarıyla Ak Portföy olarak değiştirilmesi sebebiyle, TEB Portföy Yönetimi A.Ş.' den alınmakta olan risk yönetim hizmetinin de fonun yeni portföy yöneticisi olan AK Portföy Yönetimi A.Ş. bünyesindeki Risk Yönetimi Birimi'nden alınmasına ve ayrıca risk yönetimi prosedürü olarak da AK Portföy Yönetimi A.Ş. Yönetim Kurulu tarafından 27.02.2018 tarih ve 2018/16 sayılı karar ile onaylanarak yürürlüğe giren "Emeklilik Yatırım Fonları Risk Yönetim Prosedürü ve Ekl" nin kullanılmasına karar verilmiştir.

(Karar tarihi : 13 Mayıs 2019)

4. 21 Haziran tarihinde alınan yönetim kurulu kararına istinaden Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Emanet Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu ile Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonunun, Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu bünyesinde birleştirilmesine karar verilmiştir. Bu nedenle para piyasası fonu dışındaki fonlarda geçici fon olarak kullanılan Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Emanet Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu yerine Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu' nun kullanılabilmesi amacıyla gerekli izahname değişikliklerinin yapılması için Sermaye Piyasası Kurulu' na başvuru yapılmasına karar verilmiştir. (Karar tarihi : 21 Haziran 2019)

5. Fon izahnamesinin "Fon Portföyündeki Varlıkların Alım Satımına Aracılık Eden Kuruluşlar ve Aracılık İşlemleri İçin Ödenen Komisyonlar" maddesinin değiştirilmesine ilişkin olarak Sermaye Piyasası Kurulu' na başvuru yapılmıştır. (Karar tarihi : 31 Temmuz 2019)

Fonun Risk Yönetimi

Fonun portföy yöneticisinin Risk Yönetimi Birimi tarafından günlük risk ölçümleri Risk Yönetimi Prosedürüne uygun olarak yapılmakta ve ölçümlerin sonuçları Fon Kurulu üyeleri ile paylaşılmaktadır.

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.

Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)

Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili	892,000.00	923,143.61	1.41
Diğer - Teminat	0.00	0.00	0.00
Takasbank Para Piyasası	5,483,228.59	5,483,228.59	8.39
Yurtiçi Ortaklık Payları	5,790,341.09	58,943,827.32	90.20
Fon Portföy Değeri		65,350,199.52	100.00

Portföydeki varlıkların dağılımı aşağıdaki gibidir:

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili		923,143.61	1.41
TRT170221T12	892,000.00	923,143.61	1.41
Diğer - Teminat		0.00	0.00
VIOP Nakit Teminatı	0.00	0.00	0.00
Takasbank Para Piyasası		5,483,228.59	8.39
Yurtiçi Ortaklık Payları		58,943,827.32	90.20
ADANA ÇİMENTO	29,327.00	183,014.73	0.28
ADEL KALEMCİLİK	2,153.00	33,802.10	0.05
AKBANK	855,896.02	6,941,316.69	10.62
AKÇANSA	11,103.00	111,474.12	0.17
AKİŞ G.M.Y.O.	51,140.00	206,605.60	0.32
AKMERKEZ G.M.Y.O.	2,129.00	50,414.72	0.08
AKSA	23,821.00	326,347.70	0.50
ALARKO CARRIER	488.00	29,280.00	0.04
ALARKO G.M.Y.O.	1,592.00	146,145.60	0.22
ALBARAKA TÜRK KATILIM BANKASI	88,685.00	135,688.05	0.21
ALKİM KİMYA	2,823.00	108,177.36	0.17
ANADOLU HAYAT EMEK.	21,674.41	148,252.94	0.23
ARÇELİK	54,203.00	1,129,590.52	1.73
ASELSAN	91,975.91	1,925,975.56	2.95
AVİVASA EMEKLİLİK	10,727.00	149,534.38	0.23
AYGAZ	22,318.00	286,563.12	0.44
BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR	115,559.00	5,391,982.94	8.25
BOLU ÇİMENTO	10,424.00	48,992.80	0.07
BORUSAN BORU	7,562.00	86,584.90	0.13
BOSCH FREN SİSTEMLERİ	250.00	72,475.00	0.11
BURSA ÇİMENTO	9,335.00	58,157.05	0.09
ÇELEBİ	615.00	62,791.50	0.10
ÇEMTAS	12,732.00	105,420.96	0.16

13

ÇİMSA	16,063.00	145,852.04	0.22
DATAGATE BİLGİSAYAR	3,125.00	24,406.25	0.04
DO & CO AKTIENGESELLSCHAFT	759.00	428,076.00	0.66
ECZACIBAŞI İLAÇ	40,502.00	150,262.42	0.23
ECZACIBAŞI YATIRIM	7,160.00	72,387.60	0.11
EGE ENDÜSTRİ	379.00	220,009.50	0.34
EGE GÜBRE	1,370.00	68,226.00	0.10
ENKA İNŞAAT	186,006.29	1,194,160.38	1.83
ERBOSAN	3,321.00	82,958.58	0.13
EREĞLİ DEMİR ÇELİK	512,533.00	4,633,298.32	7.09
F-M İZMİT PİSTON	627.00	31,274.76	0.05
FORD OTOSAN	20,077.00	1,422,455.45	2.18
GARANTİ BANKASI	633,596.00	7,058,259.44	10.80
GENTAŞ	25,715.00	56,315.85	0.09
GOOD-YEAR	19,307.00	78,193.35	0.12
İNDEKS BİLGİSAYAR	8,977.00	87,076.90	0.13
İSKENDERUN DEMİR VE ÇELİK	43,898.00	351,622.98	0.54
İŞ BANKASI	442,578.00	2,836,924.98	4.34
İŞ G.M.Y.O.	122,404.30	215,431.57	0.33
İŞ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	31,534.00	141,903.00	0.22
JANTSA JANT	421.00	24,544.30	0.04
KOÇ HOLDİNG	178,727.00	3,631,732.64	5.56
KONYA ÇİMENTO	250.00	67,825.00	0.10
KORDSA GLOBAL ENDÜSTRİYEL	17,262.00	225,786.96	0.35
KÜTAHYA PORSELEN	2,783.00	18,423.46	0.03
LOKMAN HEKİM	4,985.00	28,813.30	0.04
MARDİN ÇİMENTO	14,563.00	86,212.96	0.13
NUH ÇİMENTO	7,166.00	85,132.08	0.13
ODAŞ ELEKTRİK	0.16	0.34	0.00
PANORA G.M.Y.O.	8,762.00	54,324.40	0.08
PETKİM	354,647.20	1,351,205.83	2.07
PINAR ENTEGRE ET VE UN	4,529.00	41,530.93	0.06
PINAR SÜT	5,103.00	64,655.01	0.10
POLİSAN HOLDİNG	37,529.00	113,712.87	0.17
SABANCI HOLDİNG	279,513.00	2,666,554.02	4.08
SARKUYSAN	38,884.00	187,809.72	0.29
SELÇUK ECZA DEPOSU	29,747.00	181,456.70	0.28
SODA SANAYİİ	121,718.18	752,218.36	1.15
ŞİŞE CAM	242,803.66	1,279,575.26	1.96
T. VAKIFLAR BANKASI	196,048.00	1,080,224.48	1.65
T.S.K.B.	348,553.78	421,750.07	0.65
TAT GIDA	18,048.00	113,521.92	0.17
TAV HAVALİMANLARI	45,984.00	1,341,813.12	2.05
TEKFEN HOLDİNG	55,345.00	1,069,265.40	1.64
TOFAŞ OTOMOBİL FAB.	37,491.00	1,007,008.26	1.54

TRAKYA CAM	110,116.38	385,407.32	0.59
TÜPRAŞ	38,177.00	4,840,843.60	7.41
TÜRK TRAKTÖR	4,070.00	225,478.00	0.35
ULUSOY ELEKTRİK	1,516.00	40,325.60	0.06
ÜNYE ÇİMENTO	2,962.00	15,935.56	0.02
VERUSA HOLDİNG	5,848.00	108,538.88	0.17
YAPI VE KREDİ BANKASI	0.81	2.02	0.00
YENİ GİMAT G.M.Y.O	30,324.00	394,515.24	0.60
Toplam		65,350,199.52	100.00

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU	Tutar	%
Fon portföy değeri	65,350,199.52	100.07
Hazır değerler	22,486.56	0.03
Alacaklar	119,032.35	0.18
Menkul Değer Düşüş Karşılığı	0.00	0.00
Borçlar	(185,755.22)	(0.28)
Net varlık değeri	65,305,963.21	100.00

Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)

Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)