

01.01.2019 – 31.12.2019 DÖNEMİNE İLİŞKİN
ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi / Kayıt Belge No	12.09.2017 – EYF-OKS.73-1/770
İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	12.06.2017 – 194669-2017
Halka Arz Tarihi	02.01.2018
Fon Tutarı ve Pay Sayısı	1.000.000.000.- TL (Birmilyartürklirası)TL ve 100.000.000.000.- (Yüzmllyar) pay
Fon'un Türü	Değişken Fonu
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 ilgilil 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/OKS> 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:

78

1. 28.02.2019 tarihinde alınan yönetim kurulu kararı ile, kurucusu olduğumuz Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. OKS Temkinli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu'nun Portföy Yöneticisi Teb Portföy Yönetimi A.Ş. yerine Ak Portföy Yönetimi A.Ş.; Fon Kurulu Üyesi Çağrı Özel' in yerine Emrah Ayrancı olarak belirlenmiştir. Bu doğrultuda, içtüzük, izahname ve tanıtım formu değişiklikleri için Sermaye Piyasası Kurulu' na başvuru yapılmasına karar verilmiştir. Değişiklikler, Sermaye Piyasası Kurulu'ndan ("SPK") onay alınmasını müteakiben, 02.05.2019 tarihi itibarıyla:

- Fon hesap operatörü Yapı Kredi Bankası A.Ş. yerine Akbank T.A.Ş. olarak değiştirilmiştir.
- Fon müdürü İsmail Durmuş' un yerine Gönül Mutlu olarak değiştirilmiştir.

(Karar tarihi : 01 Mart 2019)

2. 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 Eki" nin kullanılmasına karar verilmiştir.

(Karar tarihi : 13 Mayıs 2019)

3. 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.


Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)


Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
OKS TEMKİNLİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili	874,000.00	843,200.47	84.85
Özel Sektör Borçlanma Araçları	80,000.00	80,164.73	8.06
Takasbank Para Piyasası	25,014.66	25,014.66	2.52
Vadeli Mevduat (TL)	45,441.73	45,441.73	4.57
Fon Portföy Değeri		993,821.59	100.00

Portföydeki varlıkların dağılımı aşağıdaki gibidir:

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili		843,200.47	84.85
TRT020322T17	20,000.00	20,585.69	2.07
TRT050220T17	20,000.00	20,547.28	2.07
TRT071020T23	80,000.00	73,727.14	7.42
TRT100620T16	160,000.00	152,847.35	15.38
TRT130520T14	245,000.00	236,183.71	23.77
TRT150120T16	40,000.00	41,949.51	4.22
TRT160920T25	144,000.00	133,498.66	13.43
TRT220921T18	165,000.00	163,861.12	16.49
Özel Sektör Borçlanma Araçları		80,164.73	8.06
AKBANK	40,000.00	40,093.82	4.03
FİNANSBANK	40,000.00	40,070.91	4.03
Takasbank Para Piyasası		25,014.66	2.52
Vadeli Mevduat (TL)		45,441.73	4.57
AKBANK	45,441.73	45,441.73	4.57
Toplam		993,821.59	100.00

NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU	Tutar	%
Fon portföy değeri	993,821.59	99.20
Hazır değerler	3,566.83	0.36
Alacaklar	12,466.16	1.24
Menkul Değer Düşüş Karşılığı	0.00	0.00
Borçlar	(8,043.63)	(0.80)
Net varlık değeri	1,001,810.95	100.00

Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)

Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)