

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

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi / Kayıt Belge No	18.04.2013 – EYF. 176 / 377
İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	15.04.2013 – 132175-2013
Halka Arz Tarihi	30.04.2013
Fon Tutarı ve Pay Sayısı	10.000.000.000 TL (Onmilyartürkirası) ve 1.000.000.000.000 (Birtrilyon) pay
Fon'un Türü	Katkı Fonu
Portföy Yönetim Şirketi	Yapı Kredi Portföy Yönetimi A.Ş.
Fon Kurulu Başkanı	Taylan Türkölmez
Fon Kurulu Üyeleri	Ersin Pak Burcu Uzunoğlu
Fon Denetçisi	F.Azade Onan
Fon Müdürü	İsmail Durmuş
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/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:

1. Fonun hazır değerler kaleminde oluşan nakit fazlası ile ilgili fon kurulu bilgilendirilmiştir. (Karar tarihi : 01 Şubat 2019)
2. 28.02.2019 tarihinde alınan yönetim kurulu kararı ile, kurucusu olduğumuz Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Katkı Emeklilik Yatırım Fonu'nun Portföy Yöneticisi HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. yerine Yapı Kredi Portföy Yönetimi A.Ş.; Fon Kurulu Üyesi Nilgün Şimşek Ata' nın yerine Emir Kadir Alpay olarak belirlenmiştir. Bu doğrultuda fon kurulu, içtüzük, Izahname 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 tarihi itibarıyla;
 - Fon hesap operatörü HSBC Yatırım Menkul Değerler A.Ş. yerine Yapı Kredi Bankası A.Ş. olarak değiştirilmiştir.
 - Fon müdürü Sevdâ Arslan'ın yerine İsmail Durmuş olarak değiştirilmiştir.(Karar tarihi : 01 Mart 2019)
3. Fonun portföy yönetim şirketinin 02.05.2019 tarihi itibarıyla Yapı Kredi Portföy olarak değiştirilmesi sebebiyle, HSBC Portföy Yönetimi A.Ş.' den alınmakta olan risk yönetim hizmetinin de fonun yeni portföy yöneticisi olan Yapı Kredi Portföy Yönetimi A.Ş. bünyesindeki Risk Yönetimi Birimi'nden alınmasına ve ayrıca risk yönetimi prosedürü olarak da Yapı Kredi Portföy Yönetimi A.Ş. risk prosedürünün kullanılmasına karar verilmiştir. (Karar tarihi : 13 Mayıs 2019)
4. 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)
5. T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından 29.05.2019 tarih ve 30788 sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Bireysel Emeklilik Sisteminde Devlet Katkısı Hakkında Yönetmelikte Değişiklik Yapılmasına Dair Yönetmelik"'e uyum sağlanması amacıyla, Fonu'nun içtüzük, Izahname ve tanıtım formlarının ilgili maddelerinin değiştirilmesi için Sermaye Piyasası Kurulu' na başvuru yapılmasına karar verilmiştir. (29 Ağustos 2019)
6. Kurul Karar Organı'nın İlke Kararı'na uyum sağlanması amacıyla, Fonu'nun karşılaştırma ölçütünün 01.01.2020 tarihinden itibaren geçerli olmak üzere Sermaye Piyasası Kuruluna başvurulmasına karar verilmiştir.

7

Eski Sekil:

**%85 BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ + %10 BIST-KYD 1 AYLIK MEVDUAT (TL) ENDEKSİ
+ %5 BIST 100 GETİRİ ENDEKSİ**

Yeni Sekil:

**%80 BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ + %10 BIST-KYD 1 AYLIK MEVDUAT (TL) ENDEKSİ
+ %10 BIST 100 GETİRİ ENDEKSİ**

(Karar tarihi : 07 Kasım 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 EMEKLİK A.Ş.** 

Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)

Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili	1,480,522,000.00	1,478,427,426.88	80.74
Diğer - Teminat	0.00	0.00	0.00
Özel Sektör Borçlanma Araçları	4,500,000.00	4,639,005.00	0.25
Takasbank Para Piyasası	57,295,906.52	57,295,906.52	3.13
Vadeli Mevduat (TL)	62,607,579.61	62,607,579.61	3.42
VDMK	10,000,000.00	10,458,700.00	0.57
Yurtiçi Ortaklık Payları	24,652,573.81	217,711,392.70	11.89
Fon Portföy Değeri		1,831,140,010.71	100.00

Portföydeki varlıkların dağılımı aşağıdaki gibidir:

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili		1,478,427,426.88	80.74
TRT020322T17	2,300,000.00	2,367,344.00	0.13
TRT080323T10	1,900,000.00	1,721,039.00	0.09
TRT080328T15	95,500,000.00	101,078,155.00	5.52
TRT110226T13	550,500,000.00	539,385,900.00	29.46
TRT110827T16	354,900,000.00	343,436,730.00	18.76
TRT120325T12	110,000.00	96,769.20	0.01
TRT120820T12	300,000.00	348,444.00	0.02
TRT140623T19	5,500,000.00	6,283,255.00	0.34
TRT140922T17	300,000.00	289,539.00	0.02
TRT170221T12	200,000.00	206,982.00	0.01
TRT170822T15	300,000.00	307,026.00	0.02
TRT180123T10	229,600,000.00	247,075,920.00	13.49
TRT181023T19	5,800,000.00	7,556,008.00	0.41
TRT200324T13	91,728,000.00	90,998,762.40	4.97
TRT220921T18	1,027,000.00	1,019,913.70	0.06
TRT240227T17	82,300,000.00	81,457,248.00	4.45
TRT240724T15	41,798,000.00	39,275,908.68	2.14
TRT270923T11	16,459,000.00	15,522,482.90	0.85
Diğer - Teminat		0.00	0.00
VIOP NAKİT TEMİNAT	0.00	0.00	0.00
Özel Sektör Borçlanma Araçları		4,639,005.00	0.25
YAPI VE KREDİ BANKASI	4,500,000.00	4,639,005.00	0.25
Takasbank Para Piyasası		57,295,906.52	3.13
Vadeli Mevduat (TL)		62,607,579.61	3.42
HALK BANKASI	62,607,579.61	62,607,579.61	3.42

VDMK		10,458,700.00	0.57
TKYB 2. Varlık Fin Fonu	10,000,000.00	10,458,700.00	0.57
Yurtiçi Ortaklık Payları		217,711,392.70	11.89
AKBANK	1,900,000.00	15,409,000.00	0.84
ANADOLU CAM	750,000.00	3,270,000.00	0.18
ARÇELİK	250,000.00	5,210,000.00	0.28
ASELSAN	500,000.00	10,470,000.00	0.57
BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR	130,000.00	6,065,800.00	0.33
COCA COLA İÇECEK	25,000.00	967,500.00	0.05
DOĞAN HOLDİNG	1,000,000.00	1,840,000.00	0.10
EMLAK G.M.Y.O.	1,250,000.00	1,825,000.00	0.10
Enerjisa Enerji A.Ş.	150,000.00	1,108,500.00	0.06
ENKA İNŞAAT	175,000.71	1,123,504.53	0.06
EREĞLİ DEMİR ÇELİK	1,500,000.00	13,560,000.00	0.74
GARANTİ BANKASI	1,450,000.00	16,153,000.00	0.88
İŞ BANKASI	2,500,000.00	16,025,000.00	0.88
KARDEMİR	2,000,000.65	5,320,001.73	0.29
KEREVİTAŞ GIDA	100,000.00	326,000.00	0.02
KOÇ HOLDİNG	425,000.00	8,636,000.00	0.47
KORDSA GLOBAL ENDÜSTRİYEL	30,000.00	392,400.00	0.02
MİGROS	100,000.00	2,422,000.00	0.13
ODAŞ ELEKTRİK	0.07	0.14	0.00
OTOKAR	33,000.00	5,247,000.00	0.29
PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI	90,000.00	7,776,000.00	0.42
PETKİM	2,500,000.00	9,525,000.00	0.52
SODA SANAYİİ	350,000.98	2,163,006.06	0.12
ŞİŞE CAM	2,000,000.75	10,540,003.97	0.58
T. VAKIFLAR BANKASI	1,250,000.00	6,887,500.00	0.38
T.S.K.B.	0.78	0.95	0.00
TAV HAVALİMANLARI	25,000.00	729,500.00	0.04
TEKFEN HOLDİNG	642,069.00	12,404,773.08	0.68
TOFAŞ OTOMOBİL FAB.	75,000.00	2,014,500.00	0.11
TORUNLAR G.M.Y.O.	250,000.00	687,500.00	0.04
TRAKYA CAM	250,000.07	875,000.26	0.05
TURKCELL	850,000.00	11,730,000.00	0.64
TÜPRAŞ	87,500.00	11,095,000.00	0.61
TÜRK HAVA YOLLARI	1,000,000.00	14,460,000.00	0.79
TÜRK TELEKOM	750,000.00	5,527,500.00	0.30
ÜLKER	265,000.00	5,925,400.00	0.32
YAPI VE KREDİ BANKASI	0.80	1.98	0.00
Toplam		1,831,140,010.71	100.00

B

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
KATKI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU	Tutar	%
Fon portföy değeri	1,831,140,010.71	103.06
Hazır değerler	4,311.88	0.00
Alacaklar	7,892,304.37	0.44
Menkul Değer Düşüş Karşılığı	0.00	0.00
Borçlar	(62,303,381.69)	(3.50)
Net varlık değeri	1,776,733,245.27	100.00


Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)


Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)