

01.01.2019 – 31.12.2019 DÖNEMİNE İLİŞKİN
ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi /Kayıt Belge No	10.06.2015 – EYF.249 / 238
İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	25.03.2015 - 91999-2015
Halka Arz Tarihi	07.09.2015
Fon Tutarı ve Pay Sayısı	1.000.000.000 TL(Birmilyartürkirası) ve 100.000.000.000 (Yüzmllyar) pay
Fon'un Türü	Değişken Fon
Portföy Yönetim Şirketi	Ata Portföy Yönetimi A.Ş.
Fon Kurulu Başkanı	Taylan Türkölmez
Fon Kurulu Üyeleri	Ersin Pak Burcu Uzunoğlu Mehmet Gerz
Fon Denetçisi	F.Azade Onan
Fon Müdürü	İsmi 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/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. Fon portföyünde bulunan ANZ İşlem kodlu fon fiyatının, fonun portföy yönetim şirketi tarafından fon operatörüne sehven hatalı bildirilmesinden dolayı, iki gün için AEO fonun fiyatı hatalı fiyat üzerinden hesaplanmıştır. İlgili günlerde fon adına herhangi bir alım işlemi olmayıp, bir adet sözleşme için satış işlemi bulunmaktadır. Satış işlemi olan katılımcının hesabına Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. hesabından fark olarak hesaplanan tutar ödenmiş ve fon kurulu bilgilendirilmiştir (Karar tarihi : 07 Mart 2019).
2. 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).
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).
4. 02.12.2019 tarih ve 2019/24 sayılı yönetim kurulu kararına istinaden Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Ata Finans Dengeli Değişken Grup Emeklilik Yatırım Fonu ile Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Ata Finans Dinamik Değişken Grup Emeklilik Yatırım Fonu'nun, Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Ata Finans Dinamik Değişken Grup Emeklilik Yatırım Fonu bünyesinde birleştirilmesine karar verilmiştir (Karar tarihi : 5 Aralık 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
ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili	1,290,000.00	1,295,673.60	46.98
Diğer - Teminat	286,157.81	286,157.81	10.38
Özel Sektör Borçlanma Araçları	600,000.00	611,537.00	22.18
Yatırım Fonu Katılma Payları	68,900.00	152,225.29	5.52
Yurtiçi Ortaklık Payları	49,904.11	412,102.49	14.94
Fon Portföy Değeri		2,757,696.19	100.00

Portföydeki varlıkların dağılımı aşağıdaki gibidir:

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Devlet Tahvili		1,295,673.60	46.98
TRT071020T23	250,000.00	230,397.50	8.35
TRT080328T15	100,000.00	105,841.00	3.84
TRT110226T13	50,000.00	48,990.00	1.78
TRT110827T16	100,000.00	96,770.00	3.51
TRT150120T16	90,000.00	94,386.60	3.42
TRT160920T25	200,000.00	185,414.00	6.72
TRT170221T12	50,000.00	51,745.50	1.88
TRT170822T15	100,000.00	102,342.00	3.71
TRT210421T14	200,000.00	231,156.00	8.38
TRT220921T18	50,000.00	49,655.00	1.80
TRT240227T17	100,000.00	98,976.00	3.59
Diğer - Teminat		286,157.81	10.38
VIOP NAKİT TEMİNAT	286,157.81	286,157.81	10.38
Özel Sektör Borçlanma Araçları		611,537.00	22.18
AKFEN HOLDİNG	80,000.00	80,630.40	2.92
ARÇELİK	70,000.00	71,211.70	2.58
ATA G.M.Y.O.	90,000.00	93,715.20	3.40
AYGAZ	80,000.00	79,734.40	2.90
EREĞLİ DEMİR ÇELİK	90,000.00	91,583.10	3.32
MİGROS	50,000.00	51,081.00	1.85
TÜPRAŞ	70,000.00	72,167.90	2.62
YDA İNŞAAT	70,000.00	71,413.30	2.59
Yatırım Fonu Katılma Payları		152,225.29	5.52
Ata Portföy Dördüncü Serbest (Döviz) Fon	42,700.00	85,794.85	3.11
Aura Portföy Yabancı Borçlanma Araçları Fonu	26,200.00	66,430.44	2.41
Yurtiçi Ortaklık Payları		412,102.49	14.94

B

AKBANK	2,450.00	19,869.50	0.72
AKSİGORTA	1,593.00	9,701.37	0.35
ALKİM KİMYA	228.00	8,736.96	0.32
ANADOLU CAM	3,724.85	16,240.35	0.59
ARÇELİK	809.00	16,859.56	0.61
AYGAZ	1,190.00	15,279.60	0.55
BAGFAŞ	491.00	8,258.62	0.30
BİZİM TOPTAN SATIŞ MAĞAZALARI	1,241.00	13,861.97	0.50
COCA COLA İÇECEK	350.00	13,545.00	0.49
ÇİMSA	704.00	6,392.32	0.23
DOĞUŞ OTOMOTİV	874.00	8,320.48	0.30
EMLAK G.M.Y.O.	8,347.00	12,186.62	0.44
EREĞLİ DEMİR ÇELİK	2,945.00	26,622.80	0.97
FORD OTOSAN	108.00	7,651.80	0.28
GARANTİ BANKASI	2,796.00	31,147.44	1.13
GÖZDE GİRİŞİM SRMY. Y.O.	1,830.00	9,406.20	0.34
İŞ G.M.Y.O.	0.92	1.63	0.00
MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	471.00	27,270.90	0.99
MİGROS	1,381.00	33,447.82	1.21
ODAŞ ELEKTRİK	5,666.00	11,898.60	0.43
ÖZAK G.M.Y.O.	5,095.00	13,094.15	0.47
PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI	93.00	8,035.20	0.29
PETKİM	0.20	0.76	0.00
SODA SANAYİİ	0.56	3.43	0.00
ŞİŞE CAM	2,548.27	13,429.37	0.49
TOFAŞ OTOMOBİL FAB.	367.00	9,857.62	0.36
TRAKYA CAM	0.24	0.84	0.00
TURKCELL	634.00	8,749.20	0.32
TÜRK HAVA YOLLARI	1,141.00	16,498.86	0.60
TÜRK TELEKOM	1,365.00	10,060.05	0.36
TÜRK TRAKTÖR	208.00	11,523.20	0.42
ÜLKER	446.00	9,972.56	0.36
YAPI VE KREDİ BANKASI	0.07	0.17	0.00
YAZICILAR HOLDİNG	806.00	14,177.54	0.51
Toplam		2,757,696.19	100.00

B

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
ATA FİNANS DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU	Tutar	%
Fon portföy değeri	2,757,696.19	99.74
Hazır değerler	6,719.46	0.24
Alacaklar	7,937.81	0.29
Menkul Değer Düşüş Karşılığı	0.00	0.00
Borçlar	(7,405.32)	(0.27)
Net varlık değeri	2,764,948.14	100.00



Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.



Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)