



# AEGON EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

## 1 OCAK - 30 HAZİRAN 2020 HESAP DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUMUNA İLİŞKİN TANITICI BİLGİLER, PERFORMANS BİLGİSİ VE DİPNOTLAR (Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

### B. PERFORMANS BİLGİSİ

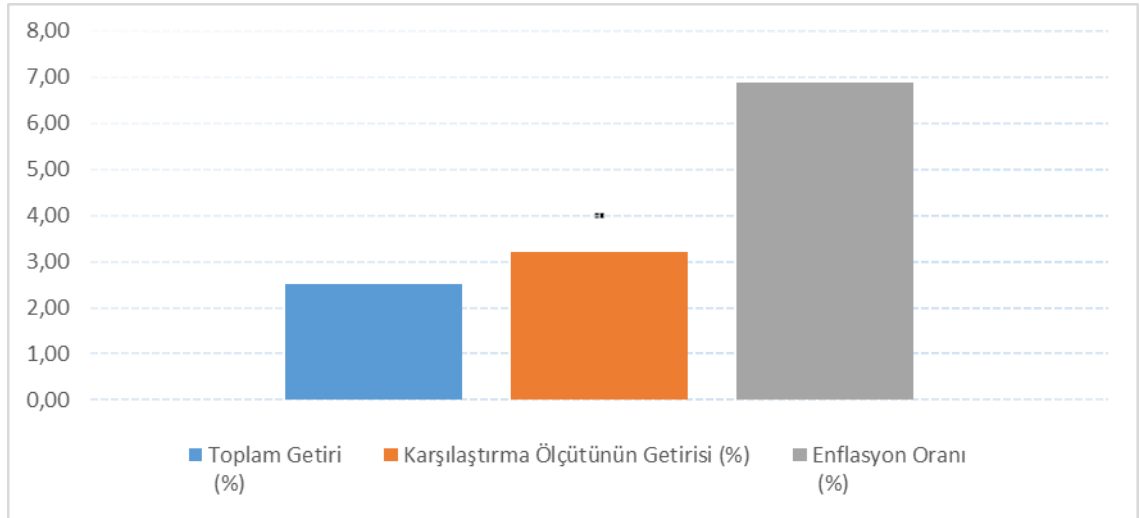
| Yıllar     | Toplam Getiri (%) | Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi (%) | Enflasyon Oranı (%) (**) | Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) (*) | Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%) (*) | Bilgi Rasyosu (%) | Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Varlık Değeri/Net Aktif Değeri (TL)(***) |
|------------|-------------------|--------------------------------------|--------------------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| 2012       | 45,30             | 47,91                                | 2,45                     | 0,86                                            | 0,96                                             | (1,43)            | 23.180.610                                                                 |
| 2013       | (10,60)           | (11,31)                              | 6,97                     | 1,59                                            | 1,71                                             | 0,31              | 21.219.196                                                                 |
| 2014       | 26,52             | 24,99                                | 6,36                     | 1,12                                            | 1,16                                             | 2,97              | 25.338.881                                                                 |
| 2015       | (12,73)           | (13,93)                              | 5,49                     | 1,28                                            | 1,26                                             | 6,00              | 20.691.837                                                                 |
| 2016       | 10,40             | 9,22                                 | 9,94                     | 1,13                                            | 1,18                                             | 2,91              | 20.839.121                                                                 |
| 2017       | 39,60             | 43,74                                | 15,47                    | 0,84                                            | 0,89                                             | (7,83)            | 26.136.668                                                                 |
| 2018       | (16,24)           | (14,81)                              | 33,64                    | 1,21                                            | 1,24                                             | (4,45)            | 18.400.952                                                                 |
| 2019       | 29,05             | 29,21                                | 7,36                     | 1,26                                            | 1,17                                             | 0,32              | 19.898.563                                                                 |
| 30.06.2020 | 2,50              | 3,21                                 | 6,89                     | 1,82                                            | 1,67                                             | (1,11)            | 19.234.489                                                                 |

(\*) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemdeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(\*\*) Enflasyon oranı; TÜİK tarafından açıklanan bir önceki yılın Aralık ayına göre ÜFE değişim oranıdır.

(\*\*\*) Belirtilen tutar, fonun 1 Temmuz 2020 uygulama tarihli net aktif değeridir.

### GRAFİK



**GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ**

# AEGON EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

## 1 OCAK - 30 HAZİRAN 2020 HESAP DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUMUNA İLİŞKİN TANITICI BİLGİLER, PERFORMANS BİLGİSİ VE DİPNOTLAR (Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

### C. DİPNOTLAR

Fonun portföy yönetim hizmeti, Sermaye Piyasası Kurulu'nun 16.12.2019 tarih ve E.15648 sayılı izni doğrultusunda 02.01.2020'den itibaren Oyak Portföy Yönetimi A.Ş. (Şirket) tarafından verilmektedir.

**C.2.** Fon, Aegon Emeklilik Ve Hayat A.Ş. Gelir Amaçlı Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fon'u unvanı ile kurulmuştur. Fon Ünvanı, 24/07/2017 itibariyle Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 14/06/2017 tarih ve E.7413 sayılı izin çerçevesinde Aegon Emeklilik ve Hayat A.Ş. Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu olarak değiştirilmiştir.

Fon portföyünün yatırım amacı ve stratejisi "A. Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde belirtilmiştir. Fon portföyünün riskleri ise aşağıda ifade edilmiştir.

- 1) Piyasa Riski: Piyasa riski ile borçlanmayı temsil eden finansal araçların, ortaklık paylarının, diğer menkul kıymetlerin, faiz oranları ve ortaklık payı fiyatlarındaki dalgalanmalar nedeniyle meydana gelebilecek zarar riski ifade edilmektedir. Söz konusu risklerin detaylarına aşağıda yer verilmektedir:
  - a. Faiz Oranı Riski: Fon portföyüne faize dayalı varlıkların (borçlanma aracı, ters repo vb) dahil edilmesi halinde, söz konusu varlıkların değerinde piyasalarda yaşanabilecek faiz oranları değişimleri nedeniyle oluşan riski ifade eder.
  - b. Ortaklık Payı Fiyat Riski: Fon portföyüne ortaklık payı dahil edilmesi halinde, Fon portföyünde bulunan ortaklık paylarının fiyatlarında meydana gelebilecek değişiklikler nedeniyle portföyün maruz kalacağı zarar olasılığını ifade etmektedir.
- 2) Karşı Taraf Riski: Karşı tarafın sözleşmeden kaynaklanan yükümlülüklerini yerine getirmek istememesi ve/veya yerine getirememesi veya takas işlemlerinde ortaya çıkan aksaklıklar sonucunda ödemenin yapılamaması riskini ifade etmektedir.
- 3) Likidite Riski: Fon portföyünde bulunan finansal varlıkların istenildiği anda piyasa fiyatından nakde dönüştürülebilmesi halinde ortaya çıkan zarar olasılığıdır.
- 4) Operasyonel Risk: Operasyonel risk, fonun operasyonel süreçlerindeki aksamalar sonucunda zarar oluşması olasılığını ifade eder. Operasyonel riskin kaynakları arasında kullanılan sistemlerin yetersizliği, başarısız yönetim, personelin hatalı ya da hileli işlemleri gibi kurum içi etkenlerin yanı sıra doğal afetler, rekabet koşulları, politik rejim değişikliği gibi kurum dışı etkenler de olabilir.
- 5) Yoğunlaşma Riski: Belli bir varlığa ve/veya vadeye yoğun yatırım yapılması sonucu fonun bu varlığın ve vadenin içerdiği risklere maruz kalmasıdır.
- 6) Korelasyon Riski: Farklı finansal varlıkların piyasa koşulları altında belirli bir zaman dilimi içerisinde aynı anda değer kazanması ya da kaybetmesine paralel olarak, en az iki farklı finansal varlığın birbirleri ile olan pozitif veya negatif yönlü ilişkileri nedeniyle doğabilecek zarar ihtimalini ifade eder.
- 7) Yasal Risk: Fonun paylarının satıldığı dönemden sonra mevzuatta ve düzenleyici otoritelerin düzenlemelerinde meydana gelebilecek değişikliklerden olumsuz etkilenmesi riskidir.
- 8) İhraççı Riski: Fon portföyüne alınan varlıkların ihraççısının yükümlülüklerini kısmen veya tamamen zamanında yerine getirememesi nedeniyle doğabilecek zarar ihtimalini ifade eder.

# AEGON EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

## 1 OCAK - 30 HAZİRAN 2020 HESAP DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUMUNA İLİŞKİN TANITICI BİLGİLER, PERFORMANS BİLGİSİ VE DİPNOTLAR (Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

### C. DİPNOTLAR (Devamı)

- C.3.** Fon'un 30 Haziran 2020 tarihi itibarıyla sona eren performans döneminde net dönemsel getirisi %2,50, karşılaştırma ölçütünün getirisi %3,21 ve nispi getiri oranı ise %(0,70) olarak gerçekleşmiştir.

Portföyün nispi getiri oranı; performans dönemi sonu itibarı ile hesaplanan portföyün vergi öncesi getiri oranından karşılaştırma ölçütünün getiri oranının veya eşik değerin çıkarılması sonucu bulunacak pozitif ya da negatif yüzdesel değerdir.

- C.4.** 1 Ocak - 30 Haziran 2020 dönemine ait yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin günlük brüt portföy değerlerine oranının ağırlıklı ortalaması %0,01'dir.

| GİDERLER                             | TUTAR (TL)        | ORTALAMA NET VARLIK DEĞERİNE ORANI (%) |
|--------------------------------------|-------------------|----------------------------------------|
| Fon Yönetim Ücreti                   | 179.021           | 0,99%                                  |
| Denetim Ücretleri                    | 11.105            | 0,06%                                  |
| Diğer Giderler                       | 9.294             | 0,05%                                  |
| Aracılık komisyon Giderleri          | 6.472             | 0,04%                                  |
| İlan Giderleri                       | 1.920             | 0,01%                                  |
| Saklama Hizmeti için Ödenen Ücretler | 1.263             | 0,01%                                  |
| <b>Toplam Giderler</b>               | <b>209.075</b>    | <b>1,15%</b>                           |
| <b>Ortalama Net Varlık Değeri</b>    | <b>18.152.736</b> |                                        |

Fon'dan karşılanan toplam giderlerin 6 aylık üst sınırı fon net varlık değerinin yıllık %1,13'ü olarak uygulanmış, aşımına ilişkin günlük olarak gider iadesi için karşılık ayırma işlemi yapılmıştır.

- C.5.** Fonun Karşılaştırma Ölçütü, %90 ağırlıkla BİST 100 Getiri Endeksi, %10 ağırlıkla KYD Brüt Repo Endeksi'dir.
- C.6.** Emeklilik yatırım fonları her türlü kurumlar vergisi ve stopajdan muaftır.

# AEGON EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

## 1 OCAK - 30 HAZİRAN 2020 HESAP DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUMUNA İLİŞKİN TANITICI BİLGİLER, PERFORMANS BİLGİSİ VE DİPNOTLAR (Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

### D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

**D.1.** Fon, 17 Kasım 2003 tarihinde halka arz edilmiştir. Fon'un kuruluşundan itibaren birikimli getirisi aşağıdaki gibidir:

|                        |                 |
|------------------------|-----------------|
| Başlangıç Tarihi       | 17 Kasım 2003   |
| Bitiş Tarihi           | 30 Haziran 2020 |
| Gün Sayısı             | 6.070           |
| Gerçekleşen Getiri (%) | 940,19%         |

**D.2.** SPK 52.1 sayılı ilke kararına göre hazırlanan Brüt Fon Getirisi:

|                                                                                                                                    |       |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|
| <b>1 Ocak - 30 Haziran 2020</b>                                                                                                    |       |
| Net Basit Getiri (Dönem sonu birim fiyat - Dönem başı birim fiyat) / Dönem başı birim fiyat)                                       | 2,50% |
| Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı (*)                                                                                         | 1,15% |
| 6 Aylık Azami Toplam Gider Oranı (**)                                                                                              | 1,13% |
| Kurucu Tarafından Karşılanan Giderlerin Oranı                                                                                      | 0     |
| Net Gider Oranı (Gerçekleşen fon toplam gider oranı - Dönem içinde kurucu tarafından karşılanan fon giderlerinin toplamının oranı) | 1,15% |

(\*) Kurucu tarafından karşılananlar da dahil olmak üzere tüm Fon giderleri, Fon muhasebesine yansıtılarak bulunan giderlerin Fon'un ortalama net varlık değerine bölünmesi ile hesaplanmıştır.

(\*\*) Gün esasına göre yıllık Fon Toplam Gider Kesintisi Oranı üzerinden 1 Ocak - 30 Haziran 2020 sunum dönemi için hesaplama yapılmıştır.

**D.3.** Bilgi Rasyosu riske göre düzeltilmiş getiri ölçümünde kullanılır. Performans ölçütü getirisi üzerindeki portföy getirisi ile portföy oynaklığı oranı olarak hesaplanır.

Fon'un 1 Ocak - 30 Haziran 2020 dönemi için hesaplanan bilgi rasyosu %(1,11)'dir.

**D.4.** Fon ile ilgili tüm değişiklikler Emeklilik Şirketi'nin internet sitesinde "Kamuyu Sürekli Bilgilendirme Formu" sayfasında ve Kamuyu Aydınlatma Platformu'nda (KAP) yer almaktadır.