

01.01.2023– 31.12.2023 DÖNEMİNE İLİŞKİN
ALLIANZ HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
HİSSE SENEDİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi /Kayıt Belge No	17.10.2003- EYF. 37-1/1237
İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	09.09.2003 – 24328-2003
Halka Arz Tarihi	27.10.2003
Fon Tutarı ve Pay Sayısı	5.000.000.000.TL(BeşmilyarTürkLirası) 500.000.000.000.- (Beşyüzmilyar)pay
Fon'un Türü	Hisse Senedi Fonu
Portföy Yönetim Şirketi	HSBC Portföy Yönetimi A.Ş.
Fon Kurulu Başkanı	Ersin Pak
Fon Kurulu Üyeleri	Taylan Türkölmez Burcu Uzunoğlu Nilgün Şimşek Ata
Fon Denetçisi	F.Azade Onan
Fon Müdürü	İsmi Durmuş
Web Adresi	https://www.allianz.com.tr/tr_TR.html
Telefon No /Faks No	(0216) 556 66 66 - (0216) 556 99 79

Piyasa Değerlendirmesi

Yıllık raporun "**BÖLÜM A: 01.01.2023-31.12.2023 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 Platformunun <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- Emeklilik Yatırım Fonlarının Kuruluş ve Faaliyetlerine ilişkin Esaslar Hakkında Yönetmeliğin "Olağanüstü Durumlar" başlıklı 27. Maddesinin 2. Fıkrasına göre, yaşadığımız doğal afet nedeniyle, 08.02.2023 tarihinden itibaren 5 iş günü olacak şekilde fon paylarının alım satımının durdurulmasına ve fonun Bireysel Emeklilik Fon Alım Satım Platformu (BEFAS) işlemlerinin durdurulmasına karar verilmiştir. (Karar tarihi:08.02.2023)

2- Şirketimizin kurucusu olduğu bireysel emeklilik yatırım fonlarının 2022 yılı faaliyetlerine ilişkin olarak, Emeklilik Yatırım Fonlarının Kuruluş ve Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Yönetmeliğin "Fonun İç Kontrol Sistemi" başlıklı 14. Maddesi ile "Risk Yönetim Sistemi" başlıklı 15. Maddesi kapsamında Fon Denetçisi tarafından hazırlanan emeklilik fonlarının iç kontrollerine ve risk yönetimine ilişkin yıllık olarak hazırlanmış olan ve ekinde fon bazında kontrol sonuçları bulunan fon denetçisi raporu Fon Kurulu'na sunulmuş ve bilgi edinilmiştir. (Karar tarihi:21.03.2023)

3- Kurucusu olduğumuz Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu için, Fon Hizmet Birimi olarak Yapı Kredi Bankası A.Ş. ile Şirketimiz arasında imzalanan Fon Hizmet Sözleşmesi kapsamındaki fon hizmetleri, operasyon ve muhasebe hizmetlerinin ifası amacıyla, Fon Kurulu ve Kurucunun yetki zorunluluğu bulunan işlemler dışında Merkezi Kayıt Kuruluşu A.Ş., Takasbank – İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş., Kıymetli Madenler Piyasası, Borsa İstanbul A.Ş. nezdinde fon adına hazırlanan talimat ve teslim dilekçelerini imzalamaya, fon adına banka ve aracı kurumlar nezdinde yapılacak menkul kıymet alım satımına, nakit transferlerine, mevduat (mevduat dönüşlerinde para çekme, mevduat bağlama , normal mevduatı enflasyona endekslie vb dönüştürme gibi tüm işlemler) ve döviz işlemlerine ilişkin olarak, en az iki imza ile limit sınırlaması olmaksızın, Fon Kurulu dışında temsil ve ilzama Yapı Kredi Bankası A.Ş.'de görev yapan aşağıda isimleri belirtilen kişilerin imza ve e-imza ile işlem yapmaya yetkili kılınmasına karar verilmiş .
"Buğra Atalay, İsmi Durmuş, Gülşen Karaca, Gürhan Yılmaz, Gözde Öztaşkın, Erdem Erkoç, Gökhan Kars, Mustafa Güler, Özge Pelin Tekin ve Mehmet Hakan Tüter"
(Karar tarihi:12.05.2023)

4- Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Hisse Senedi Emeklilik Yatırım Fonu adına kullanılan risk ölçüm modelinin doğruluğunu ve performansını ölçmek amacıyla uygulanan geriye dönük test sonucunda; Fonun risk yönetim hizmetini yapan HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. bünyesindeki Risk Yönetimi Birimi tarafından 04.01.2023, 10.01.2023, 31.01.2023, 06.02.2023, 12.05.2023 ve 24.10.2023 tarihlerinde olağandışı piyasa koşullarının varlığı nedeniyle 6 aşım gözlemlenmiştir.

Aşımalar, ilgili tarihlerde olağandışı piyasa koşulları nedeniyle piyasalarda yaşanan dalgalı volatilité nedeniyle oluşmuştur. Fonun risk yönetim hizmetini yapan HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. bünyesindeki Risk Yönetimi Birimi, tüm sonuçların ve istisna günlerin detaylı analiz çalışmaları yukarıda bahsi geçen tarihler için istisna gün kararının fon kurulunun onayına sunmuştur.

Bu dođrultuda, geriye d6n6k test kapsamında ilgili tarihlerde gerekleřen ařımlarının tamamının olađandışı piyasa kořullarından kaynaklandıđı hususu oybirliđi ile kabul edilmiřtir. (Karar tarihi:12.12.2023)

Fonun Risk Y6netimi

Fon portf6y y6neticisinin Risk Y6netimi Birimi g6nl6k risk 6l6mlerini Risk Y6netimi Prosed6r6ne uygun olarak yapmakta ve sonularını Fon Kurulu 6yeleri ile paylařmaktadır.

Ersin Pak
(Fon Kurulu Bařkanı)

Taylan T6rk6lmez
(Fon Kurulu 6yesi)

Burcu Uzunođlu
(Fon Kurulu 6yesi)

Nilg6n řimřek Ata
(Fon Kurulu 6yesi)