

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

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi /Kayıt Belge No	12.09.2017 – EYF-OKS.69-1/770
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 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:

AB

1. 28.02.2019 tarihinde alınan yönetim kurulu kararı ile, kurucusu olduğumuz Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. OKS Agresif Katılım 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 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 Yapı Kredi Bankası A.Ş. yerine Akbank T.A.Ş. olarak değiştirilmiştir.
- Fon müdürü İsmi Durmuş yerine Gönül Mutlu olarak değiştirilmiştir.

(Karar tarihi : 01 Mart 2019)

2. Fon portföyünde kullanılan risk ölçüm modelinin doğruluğunu ve performansını ölçmek amacıyla uygulanan geriye dönük test sonucunda; olağandışı piyasa koşullarının varlığı nedeniyle 3 adet aşım gözlenmiştir. (Karar tarihi : 02 Mayıs 2019)

3. 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)

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 EMEKİLİK A.Ş.

Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)

Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN
EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Kira Sertifikası (Kamu)	500,000.00	704,140.83	32.52
Özel Sektör Borçlanma Araçları	180,000.00	182,313.33	8.42
Yurtiçi Ortaklık Payları	92,220.50	1,280,361.87	59.06
Fon Portföy Değeri		2,166,816.03	100.00

Portföydeki varlıkların dağılımı aşağıdaki gibidir:

Menkul Kıymet	Nominal Değer	Rayiç Değer	%
Kira Sertifikası (Kamu)		704,140.83	32.52
TÜRK HAZİNESİ	500,000.00	704,140.83	32.52
Özel Sektör Borçlanma Araçları		182,313.33	8.42
Vakıf Varlık Kiralama	110,000.00	112,200.80	5.19
Ziraat Katılım Varlık Kiralama	70,000.00	70,112.53	3.23
Yurtiçi Ortaklık Payları		1,280,361.87	59.06
AKSU ENERJİ	632.00	9,397.84	0.43
ALARKO CARRIER	123.00	7,380.00	0.34
ALCATEL TELETAŞ	800.00	9,632.00	0.44
ALKİM KAĞIT	5,200.00	29,016.00	1.34
ALKİM KİMYA	900.00	34,488.00	1.59
BANVİT	3,027.00	56,211.39	2.59
BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR	2,161.00	100,832.26	4.65
BOSCH FREN SİSTEMLERİ	26.00	7,537.40	0.35
BURSA ÇİMENTO	1,050.00	6,541.50	0.30
ÇEMTAS	3,260.00	26,992.80	1.25
ÇUHADAROĞLU METAL	2,060.00	6,571.40	0.30
DESPEC BİLGİSAYAR	1,534.00	6,504.16	0.30
EGE ENDÜSTRİ	182.00	105,651.00	4.88
EGE GÜBRE	704.00	35,059.20	1.62
EGE SERAMİK	1,693.00	6,281.03	0.29
EREĞLİ DEMİR ÇELİK	14,200.00	128,368.00	5.92
FONET BİLGİ TEKNOLOJİLERİ	4,000.00	30,760.00	1.42
FORD OTOSAN	1,600.00	113,360.00	5.23
GENTAŞ	7,833.00	17,154.27	0.79
İSKENDERUN DEMİR VE ÇELİK	12,640.00	101,246.40	4.67
JANTSA JANT	758.00	44,191.40	2.04
KAFEN YAZILIM HİZMETLERİ	2,000.00	22,280.00	1.03

B

KARTONSAN	53.00	20,664.70	0.95
KONFRUT GIDA	2,000.00	15,640.00	0.72
KONYA ÇİMENTO	25.00	6,782.50	0.31
KRON TELEKOMÜNİKASYON	497.00	6,321.84	0.29
LOGO YAZILIM	1,952.00	118,681.60	5.48
MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	1,400.00	81,060.00	3.74
ORGE ENERJİ	9,500.00	47,120.00	2.17
PINAR ENTEGRE ET VE UN	3,386.00	31,049.62	1.43
SELÇUK ECZA DEPOSU	6,793.00	41,437.30	1.91
ULUSOY ELEKTRİK	231.00	6,144.60	0.28
YATAŞ	0.50	3.66	0.00
Toplam		2,166,816.03	100.00

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK ANONİM ŞİRKETİ
OKS AGRESİF KATILIM DEĞİŞKEN
EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHİ İTİBARIYLA
NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU	Tutar	%
Fon portföy değeri	2,166,816.03	93.51
Hazır değerler	154,423.08	6.66
Alacaklar	11,414.96	0.49
Menkul Değer Düşüş Karşılığı	0.00	0.00
Borçlar	(15,344.11)	(0.66)
Net varlık değeri	2,317,309.96	100.00


Ersin PAK
Genel Müdür Yardımcısı
(Fon Kurulu Üyesi)


Burcu UZUNOĞLU
Direktör
(Fon Kurulu Üyesi)