METLİFE EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS AGRESİF DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU (MHR)
FAALİYET RAPORU
30.06.2022

I - Fon Bilgileri

İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	: 21 Haziran 2017	
İzahname Ticaret Sicili Tescil Tarihi	: 21 Aralık 2017	
Halka Arz Tarihi	: 02 Ocak 2018	
Fon'un Türü	: Otomatik Katılım Sistemi – Agresif Değişken Fon	
Faaliyeti	: Portföy İşletmeciliği	
Kayda Alınmış Nominal Fon Tutarı	: 10.000.000.000 -TL	
Risk Grubu	: Çok Yüksek	
Portföy Yöneticisi	: Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.	
Fon Kurulu Üyeleri	: Fon Kurulu Başkanı	Raif Deniz YURTSEVEN
	Üye	Rengin UTKU
	Üye	Mutlu ÖZCAN
	Üye	Özlem ÇAYDAŞI
	Üye	Bahadır Gebece
Fon Müdürü	: Mutlu ÖZCAN	
Fon Denetçisi	: Orhan İnan, Selim Baloğlu	
Telefon No / Faks No	: 0.216.538.91.00 / 0.216.538.94.98	
E-mail Adresi	:finansmanvefonyonetimi@metlife.com.tr	
Web Adresi	:www.metlife.com.tr	

Tanım

Emeklilik Yatırım Fonu, Emeklilik Şirketleri tarafından emeklilik sözleşmesi çerçevesinde alınan ve katılımcılar adına bireysel emeklilik hesaplarında izlenen katkıların, riskin dağıtılması ve inançlı mülkiyet esaslarına göre işletilmesi amacıyla oluşturulan malvarlığıdır. Süresiz olarak kurulan fonun tüzel kişiliği yoktur. Fon, MetLife Emeklilik ve Hayat A.Ş. otomatik katılım sistemi emeklilik planları kapsamında katılımcılara sunulur.

Fonun Amacı

Bu fon, 4632 sayılı Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanununun 15. maddesi, 2 nolu Ek maddesi ve 2 nolu Geçici maddesi çerçevesinde işveren tarafından bireysel emeklilik sistemine dahil edilen, başlangıç fonundan veya standart fondan ayrılmayı tercih eden katılımcılara/çalışanlara sunulan değişken bir fon olup bu formda belirlenen risk profilindeki katılımcılara yöneliktir.

Fon'un yatırım stratejisi, "BIST-KYD 1 Aylık Mevduat (TL) Endeksi + %3" eşiğinin üzerinde yıllık getiri sağlamak amacıyla hem temettü ve faiz geliri hem de sermaye kazancı elde etmektir.

Yatırım Stratejisi

VARLIK VE İŞLEM TÜRÜ	Asgari %	Azami %
Yerli Ortaklık Payları	0	100
Yabancı Ortaklık Payları	0	50
Kamu İç Borçlanma Araçları	0	100
Vadeli Mevduat (TL /Döviz) / Katılma Hesabı (TL /Döviz)	0	25
Yurtiçi Özel Sektör Borçlanma Araçları	0	100
Yabancı Kamu ve Özel Sektör Borçlanma Araçları	0	50
Yerli Kamu Dış Borçlanma Araçları (Eurobond)	0	100
Ters Repo İşlemleri	0	10
Takasbank Para Piyasası ve Yurtiçi Organize Para Piyasası İşlemleri	0	10
Türkiye'de kurulu borsa yatırım fonu katılma payları*, yatırım fonu katılma payları, yabancı yatırım fonu payları, gayrimenkul yatırım fonu katılma payları, girişim sermayesi yatırım fonu katılma payları ve yatırım ortaklığı payları	0	20
Yabancı borsa yatırım fonu katılma payları	0	10
Yerli ve/veya Yabancı Kamu ve/veya Özel Kira Sertifikaları	0	100
Altın ve Diğer Kıymetli Madenler ve Bu Madenlere Dayalı Sermaye Piyasası Araçları	0	100
Gayrimenkul Sertifikaları	0	100
Aracı Kuruluş ve Ortaklık Varantları/Sertifikalar	0	15
Yapılandırılmış Yatırım Araçları	0	10

Fon portföy değerinin en fazla %50'si yabancı para ve sermaye piyasası araçlarına yatırılır. Fon portföyüne dahil edilen yerli ve yabancı ihraççıların döviz cinsinden ihraç edilmiş para ve sermaye piyasası araçları fon portföy değerinin devamlı olarak %80'i ve fazlası olamaz. Fon portföyünde ortaklık paylarına, her vadedeki kamu borçlanma araçlarına, TL ve döviz cinsinden mevduat ve katılma hesaplarına, risk/getiri düzeyleri değerlendirilerek ve seçici olmak suretiyle her vadede özel sektör borçlanma araçlarına yatırım yapılabilir. Likidite yönetimi ve olası getiri fırsatlarını değerlendirmek için bir miktar fon varlığı gecelik ters repoya yatırılır. Bundan başka, izahnamede yer verilen sınırlamalar dahilinde eurobondlar, TL ve döviz cinsinden mevduat ve katılma hesapları, kıymetli madenler, yatırım fonu katılma payları, yurtiçi organize para piyasası işlemleri, kira sertifikaları, gayrimenkul sertifikaları, aracı kuruluş ve ortaklık varantları gibi varlıklar da fon portföyüne dahil edilebilir. Kurul düzenlemeleri çerçevesindeki 1-7 aralığındaki fonun risk değeri 5-7 düzeyinde olacaktır. Portföye riskten korunma ve/veya yatırım amacıyla türev araç (vadeli işlem, forward, swap ve opsiyon sözleşmeleri) dahil edilebilir. Faize, döviz kuruna, ortaklık payına, ortaklık pay endeksine, özel sektör ve kamu borçlanma araçlarına, altın ve diğer kıymetli madenlere ve finansal endekslere dayalı türev araçlara, varantlara, sertifikalara, yapılandırılmış yatırım araçlarına yatırım yapılabilir.

Fon Kuruluş Bilgileri

Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 14.06.2017 tarih, 12233903-310.01.01-E.7415 sayılı izinle kuruluşuna izin verilen Fon'un içtüzüğü 21.06.2017 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından 202715-2017 sayı ile tescil edilmiş olup 28.06.2017 tarih, 9355 sayılı Ticaret Sicili Gazetesi'nde ilan edilmiştir.

06.12.2017 tarihinde Sermaye Piyasası tarafından 12233903-325.04-E.13603 sayılı belge ile kayda alınan Fon, Beykoz Vergi Dairesi'nin mükellefidir.

Katılımcıları bilgilendirme amaçlı fon izahnamesi 21.12.2017 tarihinde İstanbul Ticaret Sicili Memurluğu tarafından tescil edilmiş ve 27.12.2017 tarih, 9482 sayılı Türkiye Ticaret Sicili Gazetesinde ilan edilmiştir. 02.01.2018 tarihinden itibaren MetLife Emeklilik ve Hayat A.Ş. otomatik katılım emeklilik planları içerisinde katılımcılara sunulmaya başlanmıştır.

Dönem İçinde Meydana Gelen Değişiklikler

Fon'un 2022 yılı bağımsız denetim işlemlerinin yapılması için, aşağıda iletişim bilgileri belirtilen DRT Bağımsız Denetim ve SMMM A.Ş. firması ile anlaşma yapılmıştır.

Merkez Adresi : Deloitte Values House, No:1 34398 Maslak, İstanbul

Telefon No : 0.212.366 60 00

Internet Adresi : www.deloitte.com.tr

Dönem içinde bundan başka yatırımcı kararını etkileyecek önemli bir değişiklik olmamıştır.

Döneme Ait Fon İşlemleri

2022 yılı ilk yarısında fon portföyünün aylık bazda ortalama varlık dağılımı aşağıdaki gibi gerçekleşmiştir.

Dönem	Hisse Senedi	Takasbank Para Piyasası	Türev Araçlar	Özel Sektör Borçlanma Araçları	Ters Repo	Kamu Borçlanma Araçları	Mevduat
Ocak	88.77%	2.91%	3.65%	2.36%		1.18%	1.12%
Şubat	88.90%	4.15%	3.66%	2.47%	0.82%		
Mart	89.99%	4.13%	3.44%	2.30%	0.14%		
Nisan	93.36%	3.16%	1.29%	1.82%	0.39%		
Mayıs	84.80%	7.71%	0.21%		7.28%		
Haziran	94.05%	3.24%	1.65%		1.06%		

Fon çeşitli bankalarda mevduat işlemlerini gerçekleştirmiştir. Fon'un pay, tahvil/bono, repo ve organize para piyasası (TPP) işlemleri Deniz Yatırım Menkul Kıymetler A.Ş. aracılığı ile yapılmıştır. Fon'a ait kıymetler Takasbank'daki fon deposunda saklanmaktadır. Fon nakdi ve nakit hareketleri Deniz Yatırım A.Ş. Genel Müdürlük ve Denizbank A.Ş. Zincirlikuyu Şubesi'ndeki fon hesaplarında izlenmektedir.

Fon'un nakit ve varlık takas işlemleri MetLife Emeklilik ve Hayat A.Ş. Fon Operasyon Birimi, Denizbank ve Deniz Yatırım Menkul Değerler A.Ş. koordinasyonunda Takasbank uzaktan erişim sistemi, Denizbank Nakit Yönetimi Sistemi ve yazılı talimatlar aracılığıyla gerçekleştirilmektedir.

Fon fiyatı, portföy yapısı ve fon performansı ile ilgili bilgiler www.metlife.com.tr sitesinde hergün yayınlanmaktadır.

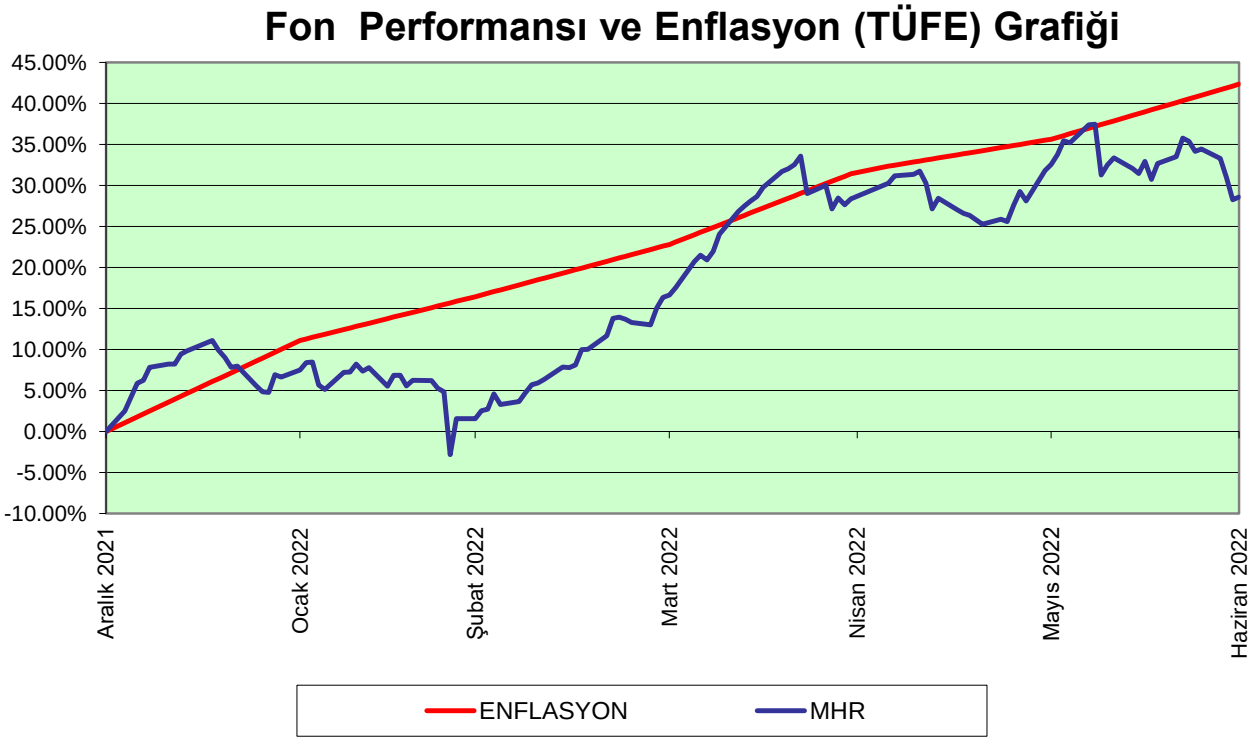
Fonun Performansına İlişkin Bilgiler

Fon portföyü, 02 Ocak 2018 tarihinde Kurucu tarafından tahsis edilen 300.000 TL avans ile oluşturulmuş olup Fon'un benchmarkına uygun portföy yapısına aynı gün geçilmiştir. Fon 02.01.2018 tarihinde halka arz edilmiştir.

31.12.2021 - 30.06.2022 döneminde;

Fon'un Birim Pay Fiyatı %28.58, * Fon'un Eşik Değeri %9.47 performans göstermiştir.

**17.06.2021 tarih, 31/927 sayılı SPK ilke kararı ile yapılan hatırlatma ile, VII-128.5 Tebliğ'in 8.maddesi gereğince; "eşik değerin getirisi BIST TLREF endeks getirisinden küçük ise eşik değer olarak BIST TLREF endeks bileşik getirisi kullanılır."*



Raif Deniz YURTSEVEN Fon Kurulu Başkanı	Rengin UTKU Fon Kurulu Üyesi	Mutlu ÖZCAN Fon Kurulu Üyesi
Özlem Çaydaşı Fon Kurulu Üyesi	Bahadır Gebece Fon Kurulu Üyesi	