

01.01.2021 - 30.06.2021 DÖNEMİNE İLİŞKİN
ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
FAALİYET RAPORU

Genel Bilgi

Kayda Alma Belgesi Tarihi /Kayıt Belge No	03.10.2003 – EYF.33-1 / 1160
İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi	11.08.2003 - 90213-2003
Halka Arz Tarihi	27.10.2003
Fon Tutarı ve Pay Sayısı	1.000.000.000 TL(Birmilyartürklirası) ve 100.000.000.000 (Yüzmilyar) pay
Fon'un Türü	Değişken Fon
Portföy Yönetim Şirketi	HSBC Portföy Yönetimi A.Ş.
Fon Kurulu Başkanı	Taylan Türkölmez
Fon Kurulu Üyeleri	Ersin Pak Burcu Uzunoğlu Nilgün Şimşek Ata Murat İman
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

Altı Aylık raporun "BÖLÜM A: 01.01.2021-30.06.2021 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:

1. Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu”, “Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Dinamik Değişken Emeklilik Yatırım Fonu” ve “Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu”nun “Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu” bünyesinde birleşecek olması nedeniyle “Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu” nun içtüzük, izahname ve tanıtım formunun değiştirilmesi için Sermaye Piyasası Kuruluna başvuru yapılmasına karar verilmiştir. (Karar tarihi : 26.02.2021)
2. Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun Portföy Yöneticisi olan ve aynı zamanda risk yönetim hizmetini de sağlayan HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. bünyesindeki “Risk Yönetimi Birimi” tarafından hazırlanan, HSBC Portföy Yönetimi A.Ş.’nin “Risk Yönetimi Uygulama Talimatı” 08.01.2021 tarih ve 6 numaralı revizyon ile güncellenmiş olup ilgili tarih itibarıyla revize edilen prosedürün kullanılmasına karar verilmiştir. (Karar tarihi : 01.03.2021)
3. Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu portföyünde bulunan, Global Yatırım Holding A.Ş.’te ait 06.04.2021 vadeli TRSGLMD42111 ISIN kodlu Özel Sektör Tahvilinin 06.04.2021 tarihinde ödeyeceği kupon ödeme tutarına ilişkin 07.01.2021 tarihinde KAP’ta yapılan duyuruda 06.04.2021 tarihli kupon ödemesinin basit faizi %4,9525 olarak belirlenmiş olup bu oran 15.02.2021 tarihinde ise KAP’ta %4,8270 olarak revize edilmiştir. İlgili kıymet için fon adına yapılan değerleme, İhraççı tarafından KAP’ta 07.01.2021 tarihinde yayımlanan kupon faiz oranına göre yapıldığından dolayı itfa gününde fon hesabında 11.295,00 TL’lik fark oluşmuştur. Oluşan fark fon portföy değerinin %0.0006’lık kısmına tekabül eden küçük bir fark olması nedeniyle ilgili farkın itfa gününde muhasebeleştirilmesine karar verilmiştir. (Karar tarihi: 06.04.2021)
4. Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. olarak, kurucusu olduğumuz Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun fon pay alım satım esasları başlığı altında yer alan ve takas süresinin bir günden fazla olduğu fonların nemalandırılması için kullanılan “Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu” nun “Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu” bünyesinde birleştirilmesi nedeniyle, nemalandırma için “Allianz Hayat ve Emeklilik A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu”nun kullanılması amacıyla Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu’nun izahname ve tanıtım formunun değiştirilmesi için Sermaye Piyasası Kuruluna başvuru yapılmasına karar verilmiştir. (Karar tarihi : 11.05.2021)

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. Fonun risk yönetim hizmetini yapan HSBC Portföy Yönetimi A.Ş. bünyesindeki Risk Yönetim Birimi tarafından 26 Ocak 2021, 18 Mart 2021 ve 19 Mart 2021 tarihlerinde olağandışı piyasa koşullarının varlığı nedeniyle 3 aşım gözlemlenmiştir.

Taylan TÜRKÖLMEZ
(Fon Kurulu Başkanı)

Ersin PAK
(Fon Kurulu Üyesi)

Burcu UZUNOĞLU
(Fon Kurulu Üyesi)

Nilgün ŞİMŞEK ATA
(Fon Kurulu Üyesi)

Murat İMAN
(Fon Kurulu Üyesi)