FİBA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş BİRİNCİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 Aralık 2019 Tarihli

Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Sermaye Piyasası Aracı	İhraçcı	Vade	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oranı	Vadeye Kalan Gün	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değeri	Grup (%)	Toplam (%)
A.HİSSE SENEDİ																
	Batisöke Söke Çimento Sanayi T.A.Ş.		BSOKE				0	0,97	15/10/2019				1,31	0	0,00	0,00
	Istanbul Gold		GLDTR				6.250	13,42	03/10/2017				26,06	162.844	58,60	0,00
	Mardin Çimento Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		MRDIN				250	5,75	30/12/2019				5,92	1.480	0,53	0,00
	Pınar Sütt Mamulleri Sanayi A.Ş.		PNSUT				100	6,88	08/08/2019				12,67	1.267	0,46	0,00
	Türk Prysmian Kablo Ve Sistemleri A.Ş.		PRKAB				396	2,03	14/10/2019				2,60	1.030	0,37	0,00
	Silverline Endüstri Ve Ticaret A.Ş.		SILVR				0	1,09	26/06/2019				2,16	0	0,00	0,00
	Söktaş Tekstil Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		SKTAS				0,00	1,58	20/09/2019				2,65	0	0,00	0,00
	Soda Sanayi A.Ş.		SODA				299,00	5,77	22/11/2019				6,18	1.848	0,66	0,00
	Torunlar Gayrimenkul Yatırım Ortaklığı A.Ş.		TRGYO				803,00	1,56	15/10/2019				2,75	2.208,25	0,79	0,00
	Türk Telekomünikasyon A.Ş.		TTKOM				373	5,79	30/10/2019				7,37	2.749	0,99	0,00
	Ülker Bisküvi Sanayi A.Ş.		ULKER				4.097	21,09	09/12/2019				22,36	91.609	32,97	0,00
	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.		VAKBN				571,00	5,16	30/12/2019				5,51	3.146,21	1,13	0,00
	Viking Kağıt Ve Selüloz A.Ş.		VKING				5.187,00	1,89	30/12/2019				1,87	9.699,69	3,49	0,00
GRUP TOPLAMI							**18.326**							**277.881**	**100,00**	**0,00**
B. BORÇLANMA ARAÇLARI																
B.1. KAMU KESİM BORÇLANMA ARAÇLARI																
Devlet Tahvili																
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT150120T32	0,00	15		2.474.000	92,21	22/08/2019	0,10			99,6182	2.464.554	4,76	0,88
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT150927T16	0,05	15	2	3.835.000	97,87	25/11/2019	0,11			104,8449	4.020.801	7,76	1,43
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT150120T16	0,05	15	2	3.500.000	94,49	29/08/2018	0,11			104,8449	3.669.571	7,08	1,31
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT030220T17	0,04	36	2	5.000.000	93,66	27/08/2019	0,11			102,7082	5.135.410	9,91	1,83
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT130320T14	0,00	134		1.500.000	90,19	15/10/2019	0,11			96,3748	1.445.621	2,79	0,52
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT080720T19	0,05	190	2	50.000	99,04	27/09/2019	0,01			103,9722	51.986	0,10	0,02
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT120820T12	0,12	225	4	1.500.000	107,54	15/03/2019	0,00			116,1154	1.741.731	3,36	0,62
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT010920T25	0,00	260		1.000.000	90,74	13/11/2019	0,11			92,6802	926.802	1,79	0,33
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT071020T23	0,00	281		4.500.000	89,95	19/11/2019	0,11			92,1320	4.145.938	8,00	1,48
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT210421T14	0,10	477	2	1.000.000	113,65	03/12/2019	0,04			115,5454	1.155.434	2,23	0,41
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT220923T18	0,05	631	2	2.050.000	90,93	16/10/2019	0,03			99,2799	2.035.238	3,93	0,73
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT030523T13	0,01	1219	2	800.000	114,50	21/04/2017	0,00			187,1071	1.496.856	2,89	0,53
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT140623T19	0,00	1261	2	1.000.000	92,56	25/07/2018	0,00			114,2066	1.142.066	2,20	0,41
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT020235T11	0,02	1310	2	100.000	141,32	21/04/2017	0,00			200,0877	200.088	0,39	0,07
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT270923T11	0,04	1366	2	70.000	97,53	21/04/2017	0,03			94,2808	65.997	0,13	0,02
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT081123T10	0,01	1408	2	1.000.000	112,51	21/04/2017	0,00			194,2570	1.942.570	3,75	0,69
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT240724T15	0,05	1667	2	400.000	93,38	09/04/2018	0,02			93,9567	375.747	0,73	0,13
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT110226T13	0,05	2234	2	200.000	75,94	13/12/2018	0,01			97,9483	195.897	0,38	0,07
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		TRT080328T15	0,06	2990	2	500.000	84,99	21/06/2018	0,00			105,8068	529.034	1,02	0,19
ARA GRUP TOPLAM							**30.479.000**							**32.741.339**	**63,20**	**11,67**
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	Türkiye Kalkınma ve Yatırım Bankası A.Ş. 2. Varlık Finansmanı Fonu	15/03/2024	TRPTVV52410	0,04	1536	4	1.000.000	100,00	15/03/2019	0,00			104,5433	1.045.433	2,02	0,37
ARA GRUP TOPLAM							**1.000.000**							**1.045.433**	**2,02**	**0,37**
Euro Tahvil (Türk)																
		18/05/2021	XS1412393172	0,02	504	6	300.000	97,28	25/07/2019				101,4565	1.807.955	3,49	0,64
		06/10/2021	XS1390320981	0,03	645	6	275.000	101,97	13/12/2019				102,5574	1.674.948	3,23	0,60
		21/04/2022	XS1508390090	0,06	842	2	200.000	101,92	13/12/2019				102,5799	1.218.649	2,35	0,43
		03/05/2022	XS1608397394	0,05	854	2	500.000	99,89	13/11/2019				100,7201	2.991.386	5,77	1,07
	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.	30/05/2022	XS1622626379	0,06	881	2	300.000	99,56	02/12/2019				100,7977	1.796.215	3,47	0,64
	Türkiye İş Bankası A.Ş.	24/10/2022	XS0847042024	0,03	1028	2	560.000	98,90	16/12/2019				101,3292	3.370.614	6,50	1,20
	Turkiye Sınai Kalkınma Bankası	16/01/2023	XS1750996206	0,03	1112	2	200.000	99,43	04/11/2019				102,3219	1.215.584	2,35	0,43
	Finansbank A.Ş.	25/01/2023	XS1711581337	0,03	1121	2	250.000	97,55	11/10/2019				100,7571	1.496.243	2,89	0,53
	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.	30/01/2023	XS1760780731	0,03	1126	2	200.000	96,04	09/07/2019				101,8408	1.209.860	2,33	0,43
	Türkiye İş Bankası A.Ş.	12/10/2023	XS1030016018	0,04	1381	2	200.000	104,52	08/10/2019				105,5834	1.254.331	2,42	0,45
ARA GRUP TOPLAM							**2.985.000**							**18.035.792**	**34,80**	**6,42**
GRUP TOPLAM							**34.464.000**							**51.822.565**	**100,02**	**18,46**
B.2. ÖZEL KESİM BORÇLANMA ARAÇLARI																
Özel Sektör Tahvil																
	Akfen Holding A.Ş.	06/01/2020	TRSAKFH12015	0,04	6	4	150.000	100,00	21/04/2017	0,00			104,1377	156.207	0,25	0,06
	Akfen Holding A.Ş.	17/11/2021	TRSAKFH62111	0,40	687	4	1.200.000	100,00	20/11/2019	0,01			101,4960	1.217.952	1,93	0,43
	Arçelik A.Ş.	12/02/2021	TRSARCL22117	0,04	409	12	890.000	100,64	27/08/2019	0,04			101,6917	905.056	1,44	0,32
	Arçelik A.Ş.	12/02/2021	TRSARCL22117	0,04	409	12	6.000.000	100,00	15/02/2019	0,04			101,6917	6.101.502	9,68	2,18
	Arçelik A.Ş.	16/07/2021	TRSARCL72112	0,04	563	12	1.000.000	100,00	24/07/2019	0,02			102,7980	1.027.980	1,63	0,37
	Aslan Çimento A.Ş.	18/06/2021	TRSASLN62118	0,04	535	12	3.200.000	100,00	21/06/2019	0,04			100,6112	3.219.559	5,11	1,15
	AYGAZ A.Ş.	18/06/2021	TRSAYGZ62110	0,04	535	12	3.850.000	100,00	21/06/2019	0,05			99,6155	3.835.950	6,09	1,37
	Bolu Çimento Sanayii A.Ş.	11/01/2021	TRSBOLU12115	0,04	377	4	3.000.000	100,00	14/01/2019	0,03			103,8654	3.115.963	4,94	1,11
	Bolu Çimento Sanayii A.Ş.	05/07/2021	TRSBOLU72119	0,04	552	12	1.000.000	100,00	08/07/2019	0,02			102,5082	1.025.082	1,63	0,37
	Çimsa Çimento Sanayi Ve Ticaret A.Ş.	18/03/2021	TRSCMSA32112	0,04	443	12	1.000.000	100,00	21/03/2019	0,05			100,4116	1.004.116	1,59	0,36
	Enerjisa Enerji A.Ş.	30/03/2023	TRSENSA32314	0,03	1185	2	100.000	100,00	05/04/2018	0,00			130,6120	130.612	0,21	0,05
	Ereğli Demir Ve Çelik Fabrikaları T.A.Ş.	26/05/2021	TRSERGLS2117	0,04	514	3	3.500.000	100,00	31/05/2019	0,03			101,7232	3.560.312	5,65	1,27
	Hektaş Ticaret T.A.Ş.	10/03/2021	TRSHEKT32123	0,05	435	12	5.400.000	100,00	13/03/2019	0,05			100,7659	5.441.464	8,63	1,94
	İş Gayrimenkul Yatırım Ortaklığı A.Ş.	25/01/2021	TRSISGY12113	0,07	391	4	2.540.000	100,00	28/01/2019	0,03			103,2377	2.622.237	4,16	0,93
	Koç Finansman A.Ş.	14/06/2021	TRSKCTF62110	0,04	531	4	2.500.000	100,00	17/06/2019	0,04			100,5973	2.514.683	3,99	0,90
	Koçtaş Yapı Marketleri Ticaret	04/03/2020	TRSKCTY52015	0,04	64	4	400.000	100,00	21/04/2017	0,14			100,889	403.189	0,64	0,14
	Opet Petrolcülük A.Ş.	19/02/2021	TRSOPAS22129	0,04	416	12	8.000.000	100,00	22/02/2019	0,03			102,40	8.192.088	13,00	2,92
	Otokoç Otomotiv Sanayi Ve Ticaret A.Ş.	15/03/2021	TRSOTKO32110	0,04	440	12	6.000.000	100,00	18/03/2019	0,05			100,68	6.040.835	9,59	2,15
	Sekerbank T.A.Ş	10/12/2027	TRSSKRBA2716	0,01	2901	12	700.000	100,43	18/07/2018	0,00			98,06	686.435	1,09	0,24
	Sarten Ambalaj Sanayi Ve Ticaret A.Ş.	09/07/2021	TRSSRTN72114	0,05	556	4	1.500.000	100,00	12/07/2019	0,02			102,78	1.541.744	2,45	0,55
	Tat Gıda Sanayi A.Ş.	23/06/2021	TRSTATK62115	0,04	548	4	700.000	100,00	26/06/2019	0,05			99,10	693.688	1,10	0,25
	Türkiye İş Bankası A.Ş.	27/07/2027	TRSTSIB72712	0,04	2765	3	600.000	100,00	08/08/2017	0,00			102,19	613.134	0,97	0,22
	Türkiye İş Bankası A.Ş.	13/09/2029	TRSTSIB92918	0,04	3544	12	2.000.000	100,00	26/09/2019	0,00			99,77	1.995.410	3,17	0,71
	Tüpraş-Türkiye Petrol Rafinerileri A.Ş.	22/01/2021	TRSTPRS12115	0,05	388	4	4.000.000	100,00	25/01/2019	0,03			103,69	4.122.117	6,54	1,47
	Tüpraş-Türkiye Petrol Rafinerileri A.Ş.	05/02/2021	TRSTPRS22114	0,05	402	4	600.000	102,20	27/08/2019	0,02			103,80	622.780	0,99	0,22
	Tüpraş-Türkiye Petrol Rafinerileri A.Ş.	05/02/2021	TRSTPRS22114	0,05	402	4	700.000	100,00	08/02/2019	0,02			103,80	726.577	1,15	0,26
	Türk Traktör Ve Ziraat Makineleri A.Ş.	03/04/2020	TRSTTRK42012	0,04	94	4	300.000	113,19	03/01/2018	0,00			104,29	312.885	0,50	0,11
	Türk Traktör Ve Ziraat Makineleri A.Ş.	03/04/2020	TRSTTRK42012	0,04	94	4	348.000	100,00	21/04/2017	0,00			104,29	362.912	0,58	0,13
	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.	06/09/2027	TRSVKFB92719	0,03	2806	4	100.000	103,69	13/03/2018	0,00			100,21	100.209	0,16	0,04
	Yda İnşaat Sanayi Ve Ticaret A.Ş.	14/02/2020	TRSYDA72015	0,05	45	4	200.000	100,00	15/12/2017	0,07			101,98	203.954	0,32	0,07
		20/06/2029	TRSYKBK42914	0,04	3459	4	500.000	100,00	03/07/2019	0,00			104,11	520.551	0,83	0,19
ARA GRUP TOPLAM							**61.978.000**							**63.017.156**	**100,00**	**22,40**
Finansman Bonosu																
	Akbank T.A.Ş.	26/03/2020	TRFAKBK32013	0,00	86		1.500.000	100,00	25/12/2019	-0,01			100,21	1.503.086	9,28	0,54
	Aytemiz Akaryakıt Dağıtım A.Ş.	24/07/2020	TRFAYTM72018	0,05	206	4	3.000.000	100,00	09/08/2019	0,05			102,34	3.070.335	18,95	1,09
	Finansbank A.Ş	11/03/2020	TRFFIBA32017	0,04	71	2	3.000.000	100,00	11/09/2019	0,22			100,62	3.018.548	18,63	1,08
	Gedik Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	23/03/2020	TRFGDKM32012	0,00	83		350.000	96,16	25/11/2019	0,13			97,34	340.682	2,10	0,12
	Oyak Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	03/02/2020	TRFOYMD22018	0,00	34		500.000	97,70	22/11/2019	0,12			98,96	494.777	3,05	0,18
	Oyak Yatırım Menkul Değerler A.Ş	26/02/2020	TRFOYMD22026	0,00	57		1.000.000	97,95	17/12/2019	0,11			98,38	983.812	6,07	0,35
	Şeker Yatırım Menkul Değerler A.Ş	19/02/2020	TRFSKMD22018	0,00	50		800.000	97,82	11/12/2019	0,12			98,47	787.774	4,86	0,28
	Yapı ve Kredi Bankası	22/06/2020	TRFYKBK62028	0,00	174	2	6.000.000	100,00	31/12/2019	0,00	Halka arz		100,03	6.001.843	37,05	2,14
ARA GRUP TOPLAM							**16.150.000**							**16.200.856**	**100,00**	**5,78**
GRUP TOPLAM							**78.128.000**							**79.218.012**		**5,78**
C. KATILMA BELGESİ																
			FSF				4.509.794	1,00	16/12/2019				1,01	4.539.288	20,87	1,62
			FRG-FİBA RE-PİE				5.550.000	1,00	13/12/2019				1,00	5.570.369	25,61	1,99
			IGL-BOSP GSYF				449.685	0,93	20/12/2019				1,05	471.286	2,17	0,17
			RPS-GTR GRS				200.000	1,00	27/12/2018				1,64	328.787	1,51	0,12
			FIB				50.239.754	0,02	01/07/2019				0,02	1.224.544	5,63	0,44
			BPZ				250.000	1,12	19/10/2017				1,48	370.397	1,70	0,13
			FIL				79.718.148	0,05	21/11/2019				0,06	4.443.569	20,43	1,58
			FPE FİBA EURBND				364.104	5,03	16/12/2019				6,32	2.302.756	10,59	0,82
			FIL				44.850.289	0,055741	31/12/2019				0,0557	2.500.000	11,49	0,89
GRUP TOPLAMI							**186.131.774**							**21.750.995**	**100,00**	**7,76**
D.TERS REPO																
Devlet Tahvili Repo																
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	02/01/2020	TRT020823T11	0,11	2		12.507.705	194,74	31/12/2019	0,12	1	6.418.855	194,80	12.503.852	44,64	4,46
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	02/01/2020	TRT061124T11	0,11	2		8.004.932	100,99	31/12/2019	0,12	1	7.921.835	101,02	8.082.465	28,57	2,85
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	02/01/2020	TRT280628T18	0,11	2		7.504.623	60.072,09	31/12/2019	0,12	1	12.485	60.090,60	7.502.311	26,79	2,67
GRUP TOPLAMI							**28.017.260**							**28.088.629**	**100,00**	**9,98**
E. VADELİ MEVDUAT																
Vadeli Mevduat (TL)																
	Finansbank A.Ş.	07/01/2020		0,12			2.000.000	100	28/11/2019	0,00			101,12	2.022.334	2,97	0,72
	Finansbank A.Ş.	23/01/2020		0,12			12.745.653	100	10/12/2019	0,00			100,72	12.836.747	18,88	4,58
	Ziraat Bankası	21/01/2020		0,11			5.070.205	100	19/12/2019	0,00			100,39	5.089.831	7,48	1,81
	Ziraat Bankası	21/01/2020		0,11			5.071.918	100	19/12/2019	0,00			100,39	5.091.549	7,48	1,82
	Ziraat Bankası	03/02/2020		0,11			2.028.082	100	25/12/2019	0,00			100,21	2.032.243	2,99	0,72
	Ziraat Bankası	03/02/2020		0,11			2.025.342	100	26/12/2019	0,00			100,21	2.029.486	2,98	0,72
	VAKIFBANK	27/01/2020		0,11			14.543.691	100	26/12/2019	0,00			100,17	14.569.056	21,43	5,19
	Arabalıbank	27/01/2020		0,11			5.058.918	100	26/12/2019	0,00			100,18	5.067.947	7,45	1,81
	Akbank T.A.Ş.	02/01/2020		0,10			13.130.084	100	31/12/2019	0,00			100,03	13.133.860	19,31	4,68
	Türk Ekonomi Ba	02/01/2020		0,10			6.125.046	100	31/12/2019	0,00			100,03	6.126.766	9,01	2,18
GRUP TOPLAMI							**67.798.939**							**67.999.832**	**100,00**	**24,23**
F. BPP																
		02/01/2020		0,11			490.290	100000	31/12/2019	0,11			100.030	490.145	1,75	0,17
		02/01/2020		0,11			5.819.426	100000	31/12/2019	0,11			100.029	5.817.713	20,77	2,07
		02/01/2020		0,11			10.005.890	100000	31/12/2019	0,11			100.029	10.002.945	35,71	3,57
		02/01/2020		0,11			10.700.290	100000	31/12/2019	0,11			100.029	10.697.149	38,19	3,81
		02/01/2020		0,11			500.295	100000	31/12/2019	0,11			100.029	500.147	1,79	0,18
		02/01/2020		0,11			500.295	100000	31/12/2019	0,11			100.029	500.147	1,79	0,18
GRUP TOPLAMI							**28.016.494**							**28.008.246**	**100,00**	**9,98**
G. TEMİNAT İŞLEMLERİ																
VIOP Nakit																
							3.439.157	1	21/04/2017				1,00	3.439.157	100,00	1,23
GRUP TOPLAMI							**3.439.157**							**3.439.157**	**100,00**	**1,23**
Döviz Bakiyeleri																
	Takasbank USD		USD				0,00						1,00	0	0,00	0,00
	İş Bankası USD Vadesiz		USD				143						1,0000	851	0,01	0,00
	Finansbank A.Ş USD Vadesiz		USD				1.462.179						1,0000	8.685.344	99,99	3,10
GRUP TOPLAMI							**0,00**							**8.686.195**	**100,00**	**3,10**
FON PORTFÖY DEĞERİ														**280.525.316**		**100,00**