FİBA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU
31 Aralık 2019 Tarihli
Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Sermaye Piyasası Aracı	Borçcu	Vade	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oranı	Vadeye Kalan Gün	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	SatışAlışTarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değeri	Grup (%)	Toplam (%)
A.HİSSE SENEDİ																
	Alcatel Lucent Teletaş Telekomünikasyon A.Ş.		ALCTL				29.000	6,51	13/05/2019				12,0400	349.160	6,65	3,01
	Alkim Alkali Kimya A.Ş.		ALKIM				12.000	25,49	28/08/2019				38,3200	459.840	8,75	3,97
	Arsan Tekstil Ticaret Ve Sanayi A.Ş.		ARSAN				50.000	2,28	10/10/2019				3,5800	179.000	3,41	1,55
	Bagfaş Bandırma Gübre Fabrikaları A.Ş.		BAGFS				300	6,32	10/07/2019				16,8200	5.197	0,10	0,04
	Batısöke Söke Çimento Sanayii T.A.Ş.		BSOKE				50.000	0,97	02/09/2019				1,3100	65.500	1,25	0,57
	Bursa Çimento Fabrikası A.Ş.		BUCIM				35.183	3,99	22/05/2019				6,2100	219.190	4,17	1,89
	Coca-Cola İçecek A.Ş.		CCOLA				10.000	30,52	05/11/2019				38,7000	387.000	7,37	3,34
	Çemtaş Çelik Makina Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		CEMTS				50.035	5,35	06/08/2019				8,2800	414.290	7,89	3,58
	Datagate Bilgisayar Malzemeleri Ticaret A.Ş.		DGATE				2	6,19	23/11/2017				7,8100	16	0,00	0,00
	Türkiye Garanti Bankası A.Ş.		GARAN				60.000	8,66	20/02/2019				11,1400	668.400	12,72	5,77
	Türkiye İş Bankası A.Ş.		ISCTR				50.000	6,22	07/06/2018				6,4100	320.500	6,10	2,77
	İskenderun Demir Ve Çelik A.Ş.		ISDMR				4.357	6,46	11/06/2019				8,0100	34.900	0,66	0,30
	İş Finansal Kiralama A.Ş.		ISFIN				100.000	2,63	11/11/2019				3,8000	380.000	7,23	3,28
	Kardemir Karabük Demir Çelik Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		KRDMA				50.000	2,15	13/09/2019				2,6500	132.500	2,52	1,14
	Pınar Entegre Et Ve Un Sanayii A.Ş.		PETUN				20.787	7,97	18/11/2019				9,1700	190.617	3,63	1,65
	Pınar Süt Mamulleri Sanayii A.Ş.		PNSUT				20.000	6,75	19/07/2019				12,6700	253.400	4,82	2,19
	Türk Prysmian Kablo Ve Sistemleri A.Ş.		PRKAB				25.000	2,68	30/12/2019				2,6000	65.000	1,24	0,56
	Silverline Endüstri Ve Ticaret A.Ş.		SILVR				0	1,11	12/07/2019				2,1600	0	0,00	0,00
	Sıkıntı Teknik Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		SKTAS				0	1,58	20/08/2019				2,6500	0	0,00	0,00
	Soda Sanayii A.Ş.		SODA				58	5,88	10/12/2019				6,1800	358	0,01	0,00
	Türk Hava Yolları A.O.		THYAO				15.000	14,11	12/04/2019				14,4600	216.900	4,13	1,87
	Tekfen Holding A.Ş.		TKFEN				15.000	18,20	28/10/2019				19,3200	289.800	5,52	2,50
	Türkiye Sınai Kalkınma Bankası A.Ş.		TSKB				17	0,83	01/08/2019				1,2100	21	0,00	0,00
	Tüpraş-Türkiye Petrol Rafinerileri A.Ş.		TUPRS				4.000	123,25	06/12/2019				126,8000	507.200	9,65	4,38
	Ulusoy Un Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		ULUUN				30.000	3,14	12/11/2019				3,8200	114.600	2,18	0,99
	Viking Kağıt Ve Selüloz A.Ş.		VKING				0	1,21	16/11/2018				1,8700	0	0,00	0,00
	Yünsa Yünlü Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		YUNSA				27	3,96	05/08/2019				10,0900	272	0,01	0,00
GRUP TOPLAMI							**630.775**							**5.253.663**	**100,00**	**45,35**
B. BORÇLANMA ARAÇLARI																
B.1. ÖZEL KESİM BORÇLANMA ARAÇLARI																
Özel Sektör Tahvil																
	Akfen Holding A.Ş.	06/01/2020	TRSAKFH12015	0,04		4	200.000	100,00	21/04/2017	0,00			104,1377	208.275	7,68	1,80
	Arçelik A.Ş	12/02/2021	TRSARCL22117	0,04		12	445.000	100,00	15/02/2019	0,04			101,6917	452.528	16,68	3,91
	Bolu Çimento Sanayii A.Ş.	11/01/2021	TRSBOLU12115	0,04		4	300.000	100,00	14/01/2019	0,03			103,8654	311.596	11,48	2,69
	Bolu Çimento Sanayii A.Ş.	05/07/2021	TRSBOLU72119	0,04		12	200.000	100,00	08/07/2019	0,02			102,5062	205.016	7,56	1,77
	İş Gayrimenkul Yatırım Ortaklığı A.Ş.	25/01/2021	TRSISGY12113	0,07		4	220.000	100,00	28/01/2019	0,03			103,2377	227.123	8,37	1,96
	Opet Petrolcülük A.Ş	19/02/2021	TRSOPAS22129	0,04		12	400.000	100,00	22/02/2019	0,03			102,4017	409.604	15,10	3,54
	Türkiye İş Bankası A.Ş.	27/07/2027	TRSTISB72712	0,04		3	300.000	100,00	08/08/2017	0,00			102,1691	306.567	11,30	2,65
	Tüpraş-Türkiye Petrol Rafinerileri A.Ş.	22/01/2021	TRSTPRS12115	0,05		4	300.000	100,00	25/01/2019	0,03			103,0529	309.159	11,39	2,67
	Türk Traktör ve Ziraat Makineleri A.Ş.	03/04/2020	TRSTTRK42012	0,04		4	174.000	100,00	21/04/2017	0,00			104,2850	181.456	6,69	1,57
	VDA İnşaat Sanayi ve Ticaret A.Ş.	14/02/2020	TRSYDAT22015	0,05		4	100.000	100,00	15/12/2017	0,07			101,9766	101.977	3,76	0,88
ARA GRUP TOPLAM							**2.639.000**							**2.712.302**	**100,00**	**23,44**
Finansman Bonosu																
	Ata Gayrimenkul Yatırım Ortaklığı A.Ş.	16/10/2020	TRFATAYE2028	4,82		4	200.000	100,00	18/10/2019	2,64			104,0745	208.149	100,00	1,80
ARA GRUP TOPLAM							**200.000**							**208.149**	**100,00**	**1,80**
B.2. KAMU KESİMİ BORÇLANMA ARAÇLARI																
Devlet Tahvili																
	T.C.Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	15/01/2020	TRT150120T16	5,25		2	200.000	96,64	06/07/2018	10,58			104,8449	209.690	17,93	1,81
	T.C.Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	03/05/2023	TRT030523T13	0,50		2	300.000	125,14	21/04/2017	0,00			187,1071	561.321	48,00	4,85
	T.C.Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	24/07/2024	TRT240724T15	4,50		2	100.000	88,32	05/07/2018	2,36			93,9367	93.937	8,03	0,81
Euro Tahvil (Tlnk)																
	Turkey Government International Bond	05/06/2020	US900123AX87	3,50		2	50.000	104,21	17.09.2019				102,5169	304.475	26,04	2,63
ARA GRUP TOPLAM							**650.000**							**1.169.423**	**100,00**	**10,10**
GRUP TOPLAMI							**3.489.000**							**4.090.874**		**35,34**
C. KATILMA BELGESİ																
			IGI-BOSP GSYF				89.933	0,93	20/12/2019				1,0480	94.253	13,90	0,81
			FIB				14.840.000	0,01	14/12/2017				0,0244	361.710	53,33	3,12
			RP2				150.000	1,12	19/10/2017				1,4816	222.241	32,77	1,92
GRUP TOPLAMI							**15.079.933**							**678.204**	**100,00**	**5,85**
D.YABANCI HİSSE																
	FTSE		IE00B4WPHX27				276	14,01	05.10.2017				14,3380	23.806	2,52	0,20
	FTSE		US46428Z819				8	116,39	05.10.2017				114,4930	5.441	0,58	0,05
	FTSE		US78463X2027				113	42,03	14-05-2018				40,6570	27.290	2,93	0,24
	FTSE		US46429B6552				870	51,12	14-05-2018				50,9180	263.133	28,22	2,27
	FTSE		US46428B5135				7	88,67	05-10-2017				87,8570	3.653	0,39	0,03
	FTSE		US46428B5135				210	86,62	31-08-2018				87,8570	109.592	11,76	0,95
	FTSE		US92206C4096				654	80,24	05-10-2017				81,0400	314.823	33,77	2,72
	FTSE		US92290B3632				35	232,54	03.10.2017				294,8300	61.295	6,57	0,53
	FTSE		US92290B3632				60	220,37	09.05.2017				294,8300	105.077	11,27	0,91
	FTSE		US92204Z8588				70	44,13	03.10.2017				44,4160	18.468	1,98	0,16
GRUP TOPLAMI							**2.303**							**932.277**	**100,00**	**8,06**
E. BPP																
		02/01/2020		10,75			190.112	100.000,00	31/12/2019	11,35			100.029,4500	190.056	100,00	1,64
GRUP TOPLAMI							**190.112**							**190.056**	**100,00**	**1,64**
F. TEMİNAT İŞLEMLERİ																
VIOP Nakit																
							436.769	1,00	21/04/2017				1,0000	436.769	100,00	3,77
GRUP TOPLAMI							**436.769**							**436.769**	**100,00**	**3,77**
FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ							**19.828.891**							**11.581.841**		**100,00**
Döviz Bakiyeleri																
	Takasbank USD						332						1,0000	1.970	0,33	0,02
	QNB Finansbank (USD)-Cari-Vadesiz						85						1,0000	503	0,08	0,00
	Finansbank A.Ş USD Vadesiz						100.695						1,0000	598.130	99,59	5,16
TOPLAMI							**101.112**							**600.603**	**100,00**	**5,18**