

FİBA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OYAK PORTFÖY KAMU DİŞ BORÇLANMA ARACI LARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 AĞUST 2019 TARİHLİ

Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Sermaye Piyasası Aracı	Birimi	Vade	ISIN Kodu	Nominal Fiyat Ölçümü	Vadeye Kalan Gün	Faiz Ödeme Sıklığı	Nominal Değer	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Koteleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Vadeli Değer	Grup (%)	Toplam (%)
ABORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvil	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteferliği	18.01.2023	TRT180123T10	6%		2	50.000	106,61	16/12/2019	0%			107,64	53.819	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							50.000,00							53.819	0,00030	0,0003
Euro Tahvil (Türk)	Turkey Government International Bond	18.05.2020	XS0903454166	5%		1	1.478.000	338,89	22/03/2018				105,04	10.342.667	0,05	0,05
	Turkey Government International Bond	18.05.2020	XS0903454166	5%		1	4.420.000	108,58	05/11/2019				105,04	30.930.034	0,16	0,15
	Turkey Government International Bond	30.03.2021	IS090123BBD29	3%		2	185.000	246,27	23/03/2018				104,27	1.149.152	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	11/12/2021	XS0903153398	4%		2	1.700.000	355,43	22/03/2018				106,20	12.027.815	0,06	0,06
	Rhodesia A.S.	11/12/2021	XS0903153398	4%		2	2.350.000	118,25	28/03/2018				106,20	16.626.684	0,08	0,08
	Rhodesia A.S.	25/01/2022	XS1711581337	3%		2	200.000	100,05	25/01/2018				100,76	1.796.954	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	23/03/2023	IS090123CAG66	2%		2	200.000	272,75	22/03/2018				97,13	1.153.873	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	11/04/2023	XS1057540009	4%		1	1.980.000	321,87	22/03/2018				109,05	14.584.434	0,07	0,07
	Turkey Government International Bond	11/04/2023	XS1057540009	4%		1	2.800.000	107,16	29/01/2019				109,05	20.341.618	0,10	0,10
	Turkey Government International Bond	22/03/2024	IS090123C355	3%		6	300.000	259,58	22/03/2018				104,10	1.855.135	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	05/02/2025	IS090123A W05	4%		2	780.000	338,90	23/03/2018				112,46	5.210.577	0,03	0,02
	Republic of Turkey	31/03/2025	XS1843443356	5%		1	400.000	100,18	08/02/2019				109,51	2.918.212	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	14/06/2025	XS1829938415	3%		1	400.000	395,66	22/03/2018				101,72	2.710.744	0,01	0,01
	Turkey Republic	16/02/2026	XS1909184753	1%		2	3.300.000	105,07	29/08/2019				113,13	24.070.595	0,13	0,12
	Turkey Government International Bond	14/04/2026	IS090123CJ75	2%		2	700.000	274,12	22/03/2018				94,50	3.929.348	0,02	0,02
	Turkey Government International Bond	09/10/2026	IS090123CAG49	0%		2	400.000	321,71	22/03/2018				96,89	2.302.157	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	25/03/2027	IS090123C122	3%		2	1.600.000	382,33	22/03/2018				103,23	9.811.132	0,05	0,05
	Turkey Government International Bond	15/01/2019	IS090123A140	12%		2	405.000	405,02	22/03/2018				148,83	5.330.836	0,03	0,03
	Turkey Government International Bond	14/02/2014	IS090123A175	4%		2	1.200.000	429,55	23/03/2018				117,79	8.296.625	0,04	0,04
	Turkey Government International Bond	17/03/2016	IS090123A160	3%		2	470.000	346,65	22/03/2018				105,43	2.943.526	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	05/03/2018	IS090123B058	4%		2	300.000	247,79	22/03/2018				108,96	1.941.612	0,01	0,01
	Turkey Government International Bond	05/03/2018	IS090123B058	4%		2	50.000	100,76	12/07/2019				108,96	323.612	0,00	0,00
	Turkey Government International Bond	30/05/2040	IS090123B046	3%		2	2.100.000	401,35	22/03/2018				101,61	12.673.138	0,06	0,06
	Turkey Government International Bond	16/04/2041	IS090123C340	2%		2	800.000	240,84	23/03/2018				83,83	3.983.732	0,02	0,02
	Turkey Government International Bond	17/02/2045	IS090123C373	3%		2	200.000	335,92	22/03/2018				101,11	1.201.189	0,01	0,01
GRUP TOPLAMI							28.916.000							198.556.912	1,00	0,94
Özel Sektör Tahvil	Akfen Holding A.Ş.	06/01/2020	TRSAKFH12015	4%		4	10.000	103,83	17/08/2018	0,00%			104,14	10.414	0,23	0,00
	Devia Holding A.Ş.	04/05/2021	TRSDVA52119	4%		4	10.000	103,62	28/09/2018	1,33%			102,49	10.249	0,22	0,00
	Dışişleri Örtmece Sanayi Ve Ticaret A.Ş.	15/03/2021	TRSDOT321210	4%		12	5.000	100,00	18/03/2019	4,33%			100,60	5.034	0,11	0,00
	Vida İnşaat Sanayi Ve Ticaret A.Ş.	16/03/2022	TRSDVAT32212	5%		4	20.000	100,43	10/01/2018	1,92%			100,47	20.093	0,44	0,00
B. KATILMA BELGESİ							45.000							45.790	1,00	0,00
Katılma Belgesi			KDS-2 EURBND				1.147.000	5,47	26/08/2019				6,65	7.624.763	1,00	0,04
C. TERS REPO							1.147.000							7.624.763	1,00	0,04
Devlet Tahvil Repo	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteferliği	02/01/2020	TRT12025T12	11%			2.501.548	85,19	31/12/2019	11,96%			85,21	2.500.774	1,00	0,01
D. BORSA PARA PİYASASI							2.501.548							2.500.774	1,00	0,01
BPP		02/01/2020		11%			180.107	100.000,00	31/12/2019	11,40%			100.029,58	180.053	1,00	0,00
E. TEMİNAT İŞLEMLERİ							180.107							180.053	1,00	0,00
VİOP Nakit							3.044.888	1,00	05/06/2017				1,00	3.044.888	1,00	0,01
GRUP TOPLAMI							3.044.888							3.044.888	1,00	0,01
VİOP SÖZLEŞMESİ																
Kısa Pozisyon	Kısa	31/01/2020	F_USDTRY0120				-475	5,998	31/12/2019				6,001	-4.050,473	0,18	-0,02
	Kısa	28/02/2020	F_USDTRY0220				-3.100	6,047	31/12/2019				6,047	-18.744,736	0,82	-0,09
Uzun Pozisyon	Uzun	28/02/2020	F_EURUSD0220				1.050	1,13	31/12/2019				1,13	7.021.615	1,00	0,03
Döviz Bakiyeleri							-2.725							-15.773,628	2,00	-0,07
	İng Bank A.Ş. USD		USD				9.843						1,00	58.466	0,78	0,00
	İng Bank A.Ş. EUR		EUR				2.415						1,00	16.092	0,22	0,00
GRUP TOPLAMI							12.358							74.558	1,00	0,00
FONORTAKLILK PORTFÖY DEĞERİ							35.884.542							212.006.997	1,00	