

FİBA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OYAK PORTFÖY DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU

Bağımız Denetimden Geçmiş
31 Aralık 2019 Tarihli

Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Sermaye Piyasası Aracı	Birim	Vade	ISIN Kodu	Nominal Fiyat Oranı	Vadeye Kalan Gün	Faiz Ödemesi Sayısı	Nominal Değer	Birim Alın Fiyatı	Satın Alın Tarihi	Kı Kısmatı Oranı	Borsa Sıralama No	Günlük Birim Değer	Toplam Değer / net Varlık Değeri	Oran (%)	Toplam (%)	
A.HİSSE SENEĐİ	Ag Anadolu Grubu Holding A.Ş.		AGHOL				7.000	12,22	23/05/2019			17,9900	123.130	1,58	0,39	
	Akbank T.A.Ş.		AKBNK				70.000	7,05	17/12/2019			8,1100	567.700	7,28	1,82	
	Arçelik A.Ş.		ARCLK				10.000	19,74	16/12/2019			20,8400	208.400	2,67	0,67	
	Astutani Elektronik Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		ASELS				5.000	19,10	24/09/2019			20,9400	104.700	1,34	0,34	
	Ereğli Demir Ve Çelik Fabrikaları T.A.Ş.		EREGL				35.000	7,76	19/11/2019			9,0400	316.400	4,06	1,01	
	Ford Otomotiv Sanayi A.Ş.		PROTO				2.400	63,98	02/12/2019			70,8500	170.800	2,18	0,54	
	Türkiye Garanti Bankası A.Ş.		GARAN				45.000	8,65	14/10/2019			11,1400	501.300	6,43	1,6	
	Türkiye Halk Bankası A.Ş.		HALKB				22.500	6,87	24/09/2019			5,9100	152.975	1,71	0,43	
	Türkiye İş Bankası A.Ş.		ISCTR				48.000	6,06	05/12/2019			6,4100	307.600	3,95	0,98	
	Koc Holding A.Ş.		KCHOL				10.000	19,95	10/12/2019			20,2200	202.200	2,62	0,65	
	Koza Altın İşletmeleri A.Ş.		KOZAL				3.850	62,89	17/12/2019			74,0500	285.093	3,66	0,91	
	Kardemir Karabük Demir Çelik Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		KRDMMD				50.000	2,14	12/07/2019			2,6600	133.000	1,71	0,43	
	Migros Ticaret A.Ş.		MIGROS				14.000	22,81	10/12/2019			24,2200	339.000	4,35	1,09	
	Mardin Çimento Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		MRDEN				20.000	4,76	31/07/2017			5,9200	118.400	1,52	0,38	
	Net Holding A.Ş.		NTHOL				25.000	1,60	02/08/2019			2,6000	65.000	0,83	0,21	
	Petkim Petrokimya Holding A.Ş.		PETKIM				100.000	3,71	03/09/2019			3,8100	381.000	4,89	1,22	
	Hacı Ömer Sabancı Holding A.Ş.		SABOL				57.500	8,68	24/12/2019			9,5400	588.550	7,04	1,75	
	Türkiye Şişe Ve Cam Fabrikaları A.Ş.		SISE				82.500	5,08	14/10/2019			5,2700	434.775	5,58	1,39	
	Soda Sanayi A.Ş.		SODA				57.050	6,04	16/08/2019			6,1800	352.569	4,52	1,13	
	Tay Havaimardan Holding A.Ş.		TAHVIL				5.500	29,76	27/12/2019			29,1800	100.400	1,28	0,31	
	Turkcell İletişim Hizmetleri A.Ş.		TCCELL				25.000	13,44	12/12/2019			13,8000	345.000	4,43	1,1	
	Türk Hava Yolları A.O.		THYAO				50.000	12,71	17/12/2019			14,4600	723.000	9,28	2,31	
	Teflon Holding A.Ş.		TKFEN				10.000	19,23	27/12/2019			19,3200	193.200	2,48	0,62	
	Türk Telekomünikasyon A.Ş.		TTKOM				35.000	6,12	20/11/2019			7,7300	237.950	3,31	0,83	
	Tipsany Türkiye Petrol Rafinerileri A.Ş.		TIPIRES				5.400	130,71	04/11/2019			126,8000	484.720	6,19	1,55	
	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.		VAKBN				25.000	5,10	16/12/2019			5,5100	137.750	1,77	0,44	
	GRUP TOPLAMI							828.700						7.795.182	100,02	24,95
	B.ÖZEL KESİM BORÇLANMA ARAÇLARI															
	DEVLET TAHVİLİ															
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		15/01/2020	TRT150120716	0,05		2	1.000.000	103,74	29/11/2019	0,11		104,8449	1.048.449	13,11	3,36
		T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	05/02/2020	TRT050220717	0,04		2	1.000.000	97,86	23/07/2019	0,11		102,7082	1.027.082	12,84	3,29
		T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	12/08/2020	TRT120820712	0,12		4	500.000	108,87	19/09/2019	0,00		116,1154	580.577	7,26	1,86
		T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	16/09/2020	TRT160920725	0,00			500.000	92,73	31/12/2019	0,11		92,6802	463.401	5,79	1,48
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		07/10/2020	TRT071020723	0,00			500.000	95,76	31/11/2019	0,11		92,1320	460.660	5,76	1,47	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		21/04/2021	TRT210421714	0,10		2	500.000	95,91	16/05/2019	0,04		115,5434	577.717	7,22	1,85	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		21/04/2021	TRT210421714	0,10		2	500.000	115,21	31/12/2019	0,04		115,5434	577.717	7,22	1,85	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		22/09/2021	TRT220921718	0,05		2	1.000.000	97,62	02/12/2019	0,03		99,2799	992.799	12,61	3,18	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		02/03/2022	TRT020322717	0,06		2	500.000	93,93	14/10/2019	0,01		102,8972	514.486	6,43	1,65	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		28/05/2021	TRT280521714	0,04		2	500.000	106,93	02/01/2020	0,00		106,9980	534.990	6,69	1,71	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		18/01/2023	TRT180123710	0,06		2	500.000	106,75	02/01/2020	0,00		106,9980	534.990	6,69	1,71	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		08/03/2023	TRT080323710	0,04		2	40.000	80,77	17/11/2017	0,04		90,5259	36.221	0,45	0,12	
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		18/10/2023	TRT181023719	0,10		12	500.000	127,28	16/12/2019	0,00		130,2635	651.183	8,14	2,08	
ARA GRUP TOPLAMI							7.540.000						8.000.271	100,01	25,61	
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ																
Adana Çimento Sanayi T.A.Ş.		07/09/2020	TRSDADN92011	0,26		4	100.000	104,68	14/11/2018	0,39		100,9400	100.940	2,37	0,32	
	Aldem Holding A.Ş.	06/01/2020	TRSAKHI12015	0,04		4	350.000	102,03	05/06/2017	0,00		104,1377	364.482	8,57	1,17	
	Aldem Holding A.Ş.	19/03/2020	TRSAKHI20013	0,05		4	10.000	100,85	13/07/2017	0,15		100,7478	10.075	0,24	0,03	
	Akfen Holding A.Ş.	17/11/2021	TRSAKFHK2111	0,40		4	1.250.000	100,00	20/11/2019	0,01		101,4960	1.268.700	29,81	4,05	
	Bolu Çimento A.Ş.	11/01/2021	TRSBOLU12115	0,04		4	10.000	100,00	14/01/2019	0,03		103,8654	10.387	0,24	0,03	
	Dewa Holding A.Ş.	04/05/2021	TRSDVSA1519	0,04		4	50.000	100,00	07/05/2018	0,01		102,4899	51.244	1,2	0,14	
	Duşgün Holding A.Ş.	26/07/2021	TRSDOGH72112	0,04		4	100.000	100,00	31/07/2017	0,09		90,5503	90.550	2,13	0,29	
	Ereğli Demir ve Çelik Fabrikası	28/05/2021	TRSERGL52117	0,04		3	750.000	100,00	31/05/2019	0,03		101,7232	762.924	17,93	2,44	
	Heiway Ticaret T.A.Ş.	18/12/2020	TRSHKTA2014	0,05		4	100.000	100,00	03/01/2019	0,07		100,4408	100.353	1,89	0,24	
	Hayat Varlık Yönetim A.Ş.	04/02/2020	TRSHVYV22012	0,06		4	100.000	100,00	07/11/2017	0,17		102,8123	102.813	2,62	0,33	
	Hayat Varlık Yönetim A.Ş.	11/09/2020	TRSHVYV20015	0,04		4	5.000	100,00	15/09/2017	0,06		100,7745	5.029	0,12	0,02	
	İç Geyimcilik Yatırım Ortaklığı A.Ş.	25/01/2021	TRSGGYV12111	0,07		4	20.000	100,00	28/01/2019	0,03		102,2377	20.468	0,49	0,07	
	Koçtaş Yapı Marketleri Ticaret A.Ş.	04/03/2020	TRSKCTY32015	0,04		4	100.000	100,00	21/04/2017	0,14		100,7973	100.797	2,37	0,32	
	Migros Ticaret A.Ş.	14/07/2021	TRSMGTT72110	0,05		4	70.000	100,00	19/07/2018	0,01		104,4222	73.096	1,72	0,23	
	Migros Ticaret A.Ş.	20/12/2021	TRSMGTA32118	0,05		4	70.000	100,00	23/12/2019	0,01		100,3165	140.222	1,62	0,22	
	Orfin Finansman A.Ş.	24/07/2020	TRSORFN72013	0,04		4	410.000	102,81	16/01/2019	0,02		102,4986	420.244	9,88	1,34	
	Orfin Finansman A.Ş.	30/10/2020	TRSORFN2019	0,05		4	320.000	103,57	04/10/2019	0,01		102,9480	329.433	7,74	1,05	
	Palçaz Döğürler Değirmen San. ve Tic. A.Ş.	14/05/2020	TRSPDLG2014	0,05		4	200.000	100,00	15/05/2018	0,07		102,1925	204.855	4,8	0,65	
	Türk Tütün ve Ziraat Makineleri A.Ş.	03/04/2020	TRSTTKA2012	0,04		4	85.000	100,00	21/04/2017	0,00		104,2530	85.462	2,08	0,28	
	YDA İnşaat Sanayi ve Ticaret A.Ş.	16/03/2022	TRSYDAT32212	0,05		4	100.000	100,32	10/01/2018	0,02		100,4661	100.466	2,36	0,32	
ARA GRUP TOPLAMI							4.180.000						4.255.428	100,01	13,59	
FİNANSMAN BONUSU																
Fibabanka A.Ş.		11/03/2020	TRFFBA32017	0,04		2	500.000	100,00	11/09/2019	0,22		100,6183	503.091	100,00	1,61	
ARA GRUP TOPLAMI							500.000						503.091	100,00	1,61	
GRUP TOPLAMI							12.228.000						12.758.790	100,01	40,81	
C.KATILMA BELGESİ																
KATILMA BELGESİ																
OTK SERBEST FON							500.000	1,00	31/10/2017			1,4154	707.717	26,97	2,26	
	ÖHB BİR HİSSE						397.058	1,01	29/03/2018			508.134	19.36	1,63		
	ÖGM OYAK GYR						500.000	1,00	15/05/2019			1,0767	538.362	20,51	1,72	
	ÖÖS Z. FUNDING						130.896	5,59	26/08/2019			6,6476	870.140	33,56	2,78	
D.TERS REPO							1.527.954						2.624.353	100,00	8,39	
DEVLET TAHVİLİ REPO																
T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı		02/01/2020	TRT041128711	0,11			2.501.549	97,75	31/12/2019	0,12		97,7810	2.500.775	100	8	
E.VADELİ MEVDUAT							2.581.549						2.500.775	100,00	8,00	
VADELİ MEVDUAT (TL)																
Türkiye Halk Bankası A.Ş.		07/01/2020					1.065.371	100,00	03/12/2019	0,00		100,9520	1.075.519	31,83	3,44	
	Fibabanka A.Ş.	07/01/2020					570.711	100,00	03/12/2019	0,00		100,9530	570.681	17,06	1,84	
	Denizbank A.Ş.	07/01/2020					1.065.111	100,00	03/12/2019	0,00		100,9570	1.075.088	31,85	3,44	
	Fibabanka A.Ş.	27/01/2020					648.972	100,00	24/12/2019	0,00		100,2290	650.460	19,26	2,08	
F.BORSA PARA PİYASASI							3.350.166						3.377.181	100,00	10,83	
BİPP		02/01/2020					503.296	100.000,00	31/12/2019	0,11		100.029.4500	503.148	100	1,61	
G.TEMİNAT İŞLEMLERİ																
VIOP Nakı							1.690.056	1,00	21/07/2017			1.0000	1.690.056	100	5,41	
VIOP SÖZLEŞMESİ							1.690.056						1.690.056	100,00	5,41	
Kısa Pozisyon	Kısa	21/01/2020	F.USDT2019120				-50,00		30/12/2019			6,0010	-300.035	27,49	-0,26	
Kısa		29/02/2020	F.XU0080220				-56,00		14/03			141,2000	-791.280	72,51	-0,25	
GRUP TOPLAMI							-106						-1.091.315	100,00	-3,49	
FONORTAKLİK PORTFÖY DEĞERİ																
							22.613.722						31.249.325		100,00	