

FİBA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 Aralık 2019 Tarihli

Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarih	Menkul Tanımı	Nominal Fiyat Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger / Kontre Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satış Alış Tarih	İç Iskonte Oran	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Gr up (%)	Toplam (%)
A.İHŞSE SENEDİ																
Hisse Senetleri	Anadoluh Efes Bırmcılık Ve Malt Sanayii A.Ş.		AEFFES			150	22,30	23/09/2019				21,0800	1	3.462	0,98	0,34
	Akbank T.A.Ş.		AKBNK			3.860	6,95	14/11/2019				8,1100	1	24.817	7,04	2,41
	Açelsib A.Ş.		ARCLK			745	19,34	16/12/2019				20,8400	1	15.526	4,40	1,51
	Auchan Elektronik Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		ASELS			500	18,51	02/12/2019				20,9400	1	10.470	2,97	1,02
	Ergil Deniz Ve Çelik Fabrikaları T.A.Ş.		ERDGL			2.000	7,83	19/11/2019				9,0400	1	18.080	5,13	1,76
	Erol Önemli Sanayi A.Ş.		EROTO			90	88,39	02/12/2019				70,8500	1	6.377	1,81	0,62
	Türkiye Garanti Bankası A.Ş.		GARAN			2.375	9,12	14/11/2019				11,1400	1	26.458	7,50	2,57
	Türkiye Halk Bankası A.Ş.		HALKBİ			1.720	5,44	14/11/2019				5,9100	1	10.165	2,88	0,99
	Türkiye İş Bankası A.Ş.		ISCTR			2.550	6,04	05/12/2019				6,4100	1	16.546	4,64	1,59
	Koc Holding A.Ş.		KCHOL			500	19,92	19/12/2019				20,3200	1	10.160	2,88	0,99
	Kora Alın İşletmeleri A.Ş.		KOZAL			120	59,15	29/11/2019				74,0500	1	8.886	2,52	0,86
	Kardemir Karabük Demir Çelik Sanayi Ve Ticaret A.Ş.		KRDMD			2.000	2,30	14/11/2019				2,6600	1	5.320	1,51	0,52
	Migros Ticaret A.Ş.		MGROS			550	22,84	10/12/2019				24,2200	1	13.321	3,78	1,29
	Net Holding A.Ş.		NTHOL			1.000	1,60	02/08/2019				2,6000	1	2.600	0,74	0,25
	Pektaş Petrolkimya Holding A.Ş.		PTCKM			5.115	3,70	14/11/2019				3,8100	1	19.625	5,57	1,91
	Hacı Ömer Sabancı Holding A.Ş.		SAHOL			2.260	8,57	24/12/2019				9,5400	1	21.560	6,11	2,10
	Türkiye Şişe Ve Cam Fabrikaları A.Ş.		SİSİE			3.125	4,41	21/11/2019				5,2700	1	16.469	4,67	1,60
	Seda Sanayi A.Ş.		SODA			1.650	6,00	16/08/2019				6,1800	1	10.197	2,89	0,99
	Tav Havalimanları Holding A.Ş.		TAVHL			500	29,78	26/12/2019				29,1800	1	14.590	4,14	1,42
	Turkcell İletişim Hizmetleri A.Ş.		TCCELL			1.095	13,19	12/12/2019				13,8000	1	15.111	4,29	1,47
	Türk Hava Yolları A.O.		THYAO			1.915	12,62	14/11/2019				14,4600	1	27.691	7,85	2,69
	Tekfen Holding A.Ş.		TKFEN			200	18,25	14/11/2019				19,3200	1	3.864	1,10	0,38
	Tofaş Türk Otomobil Fabrikası A.Ş.		TOASO			100	17,29	22/08/2019				26,8600	1	2.686	0,76	0,26
	Türkiye Cam Sanayi A.Ş.		TKRCM			700	2,17	19/08/2019				2,5000	1	2.450	0,69	0,24
	Türk Telekomünikasyon A.Ş.		TTKOM			1.340	5,52	28/11/2019				7,3700	1	9.876	2,80	0,96
	Tüpraş-Türkiye Petrol Rafinerileri A.Ş.		TUPRS			190	127,35	13/12/2019				126,8000	1	24.092	6,83	2,34
	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.		VAKBN			2.250	5,01	23/12/2019				5,5100	1	12.298	3,52	1,20
	Yapı Ve Kredi Bankası A.Ş.		YKBNK			0	2,47	15/11/2019				2,4800	1	0,01	-	-
GRUP TOPLAMI						37.836								352.595	100,00	34,28
B.BORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvil	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	15/01/2020	TRT150120T32	0,00		5.000	86,17	19/03/2019	10,49			99,6102	1	4.981	1,04	0,48
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	15/01/2020	TRT150120T16	5,25	2	10.000	95,68	22/03/2019	10,58			104,8449	1	10.484	2,20	1,02
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	05/02/2020	TRT050220T17	3,70	2	102.000	100,28	16/12/2019	10,54			102,7082	1	104.762	21,97	10,18
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	13/05/2020	TRT130520T14	0,00		53.000	84,98	07/11/2019	10,67			96,3748	1	51.679	16,71	4,96
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	10/06/2020	TRT100620T16	0,00		20.000	80,53	17/06/2019	11,00			95,5023	1	19.100	4,01	1,86
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	08/07/2020	TRT080720T19	4,70	2	5.000	100,79	15/11/2019	1,36			103,9722	1	5.199	1,09	0,51
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	12/08/2020	TRT120820T12	11,50	30	10.000	113,11	04/10/2019	0,00			116,1154	1	34.835	7,31	3,39
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	16/09/2020	TRT160920T25	0,00		30.000	90,45	14/11/2019	11,31			92,6882	1	27.804	5,83	2,70
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	17/02/2021	TRT170221T12	5,35	2	40.000	101,97	05/12/2019	2,21			103,4607	1	41.384	8,68	4,02
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	22/09/2021	TRT220921T18	4,60	2	40.000	97,74	03/12/2019	3,07			99,2799	1	39.712	8,33	3,86
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	12/01/2022	TRT120122T17	4,75	2	10.000	78,67	09/06/2019	1,74			101,1386	1	10.114	2,12	0,88
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	02/03/2022	TRT020322T17	5,50	2	5.000	102,82	31/12/2019	1,16			102,8972	1	5.145	1,08	0,50
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	02/03/2022	TRT020322T17	5,50	2	10.000	80,28	04/04/2019	1,16			102,8972	1	10.290	2,16	1,00
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	17/08/2022	TRT170822T15	5,35	2	22.000	92,88	13/12/2019	1,12			102,3112	1	22.508	4,72	2,19
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	18/01/2023	TRT180123T10	6,10	2	20.000	106,05	27/12/2019	0,00			107,6375	1	21.528	4,52	2,09
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	20/03/2024	TRT200324T13	5,20	40	20.000	71,43	18/04/2019	1,41			99,1745	1	19.835	4,16	1,93
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	24/07/2024	TRT240724T15	4,50	2	40.000	92,41	24/12/2019	2,36			93,9367	1	37.575	7,88	3,65
	T.C. Başbakanlık Hazine Müsteşarlığı	14/07/2021	TRD140721T18	4,70	2	10.000	86,86	26/02/2019	3,34			104,0238	1	10.401	2,18	1,01
ARA GRUP TOPLAMI						472.000								476.736	100,00	46,33
Özel Sektör Tahvil	Adana Cimento Sanayii T.A.Ş.	07/09/2020	TRSAADNA0201	26,27	4	20.000	103,50	15/11/2019	38,66			100,9400	1	20.188	17,92	1,96
	Akfen Holding A.Ş.	19/03/2020	TRSAKFHD2013	4,73	4	20.000	102,90	15/11/2019	15,40			100,7478	1	20.150	17,88	1,96
	Bolu Cimento A.Ş.	11/01/2021	TRSBOLU121115	4,40	4	10.000	102,54	21/08/2019	2,90			103,8654	1	10.387	9,22	1,01
	Bilgin Ticaret T.A.Ş.	18/12/2020	TRBSHCKT2011	4,51	4	20.000	102,61	02/10/2019	6,55			100,4408	1	20.088	17,83	1,95
	Migros Ticaret A.Ş.	14/07/2021	TRSMGT172110	4,99	4	20.000	101,78	21/08/2019	0,92			104,4222	1	20.884	18,54	2,03
		26/02/2020	TRSBOTK022012	7,59	6	20.000	103,24	29/11/2019	84,73			104,8295	1	20.966	18,61	2,04
ARA GRUP TOPLAMI						110.000								112.663	100,00	10,95
GRUP TOPLAMI						582.000								589.398		57,28
C.VADELİ MEVDUAT																
Vadelî Mevduat (TL)	Türkiye Halk Bankası A.Ş.	07/01/2020		11,75		16.654	100,00	03/12/2019	0			100,9330	1	16.810	50,00	1,63
	Demirbank A.Ş.	07/01/2020		11,80		16.651	100,00	03/12/2019	0			100,9570	1	16.807	50,00	1,63
GRUP TOPLAMI						33.305								33.616	100,00	3,26
D.BORSA PARA PİYASASI																
BPP		02/01/2020		10,75		6.004	100.000,00	31/12/2019	11,36			100029.3300	1	6.002	100,00	0,58
GRUP TOPLAMI						6.004								6.002	100,00	0,58
E.TEMİNAT İŞLEMLERİ																
VIOP Nakit						47.285	1,00	17/08/2018				1,0000	1	47.283	100,00	4,60
GRUP TOPLAMI						47.285								47.283	100,00	4,60
FON PORTFÖY DEĞERİ						706.430								1.028.997		100,00
VIOP SÖZLEŞMESİ																
Kısa Pozisyon	Kısa	31/01/2020	F_USDTRY0120			-4	6,00	27/12/2019				6,0010	1	-24.003	100,00	- 2,33
GRUP TOPLAMI						-4								-24.003	100,00	- 2,33
DÖVİZ BAKİYELERİ																
	Taksibank EUR		EUR			12						1	6,6621	82	100,00	0,01
GRUP TOPLAMI						12								82	100,00	0,01