

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
BİRİNCİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
01.01.2019– 30.06.2019 DÖNEMİ FON FAALİYET RAPORU

I. FON İLE İLGİLİ BİLGİLER

Fonun Ünvanı: Cigna Finans Emeklilik Ve Hayat A.Ş Birinci Değişken Emeklilik Yatırım Fonu

Fonun Türü: Değişken

İçtüzük Ticaret Siciline Tescil Tarihi ve No : 07.07.2008 /58352-2008

İzahname Ticaret Sicili Tescil Tarihi ve No : 24.10.2008 / 86655-2008

Halka Arz Tarihi : 07.11.2008

Fon Tutarı : 100.000.000.- (yüzmilyon) TL

Portföy Yöneticisi : QNB Finans Portföy Yönetimi A.Ş.

Fon Denetçisi: Beyhan TUNCAY

Fon Müdürü : Gürkan ALTINAY

Fon Kurulu Üyeleri:

Ziya ÇAKMAK	Fon Kurulu Başkanı	QNB Finans Portföy Yönetimi A.Ş.
Murat İNCE	Fon Kurulu Üyesi	QNB Finans Portföy Yönetimi A.Ş.
Bahar ÇAKAN	Fon Kurulu Üyesi	QNB Finans Portföy Yönetimi A.Ş.
Elif Bilmez	Fon Kurulu Üyesi	Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.
Ece Kazancılar	Fon Kurulu Üyesi	Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.

II. FON PORTFÖY BİLGİLERİ

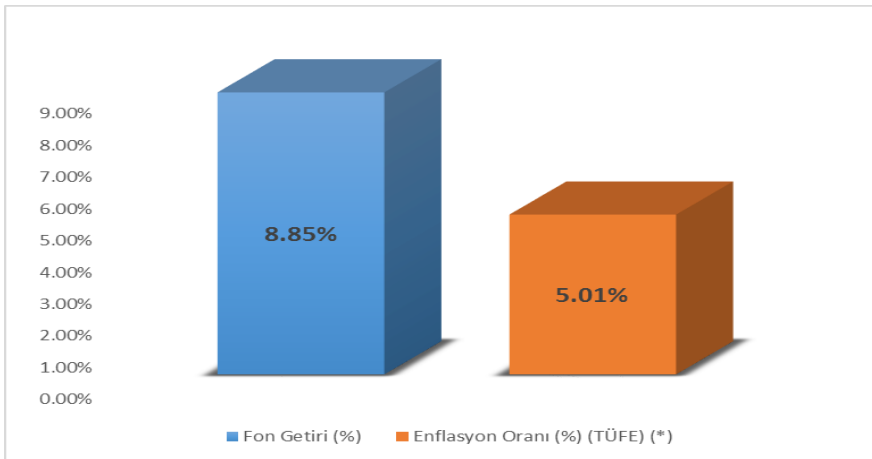
28/06/2019 tarihi itibarıyla (*)	
Fon Toplam Değeri	113,677,707
Birim Pay Değeri (TRL)	0.027753
Yatırımcı Sayısı	50,986
Tedavül Oranı (%)	40.96%

Portföy Dağılımı	
Borçlanma Araçları	62.06%
- Devlet Tahvili / Hazine Bonosu	52.69%
- Özel Sektör Borçlanma Araçları	8.65%

- Özel Sektör Kira Sertifikası	0.72%
Paylar	12.96%
- Bankacılık	3.82%
- Diğer	1.94%
- Hava Yolları Ve Hizmetleri	1.35%
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	0.93%
- Holding	0.78%
- Perakende	0.70%
- Demir, Çelik Temel	0.65%
- Kimyasal Ürün	0.55%
- Gıda	0.51%
- Otomotiv	0.50%
- Madencilik	0.46%
- Endüstriyel Tekstil	0.32%
- Cam	0.22%
- Dayanıklı Tüketim	0.17%
- Biracılık Ve Meşrubat	0.03%
- Otomotiv Lastiği	0.03%
- Mobilya	0.00%
Ters Repo	8.76%
Vadeli Mevduat	8.25%
Takasbank Para Piyasası İşlemleri	7.28%
Teminat	0.69%

III. FON PERFORMANS BİLGİ

01.01.2019 – 30.06.2019 tarihindeki fon performans bilgilerine performans raporlarından ulaşılabilir.



(*) Enflasyon Oranı TÜİK Tarafından Açıklanan Bir önceki yılın aralık ayına göre değişim Oranını Göstermektedir.

IV. FONUN YATIRIM STRATEJİSİ

Fon portföyünün tamamını değişen piyasa koşullarına göre Yönetmelik'in 5. maddesinde belirtilen yerli ve yabancı varlık türlerinin tamamına veya bir kısmına yatıran ve hem sermaye kazancı hem de temettü ile beraber faiz geliri elde etmeyi hedefleyen bir fondur. Fon, uzun vade perspektifiyle, orta risk düzeyinde, reel getiri performansı hedefiyle hareket eder. Fon, ağırlıklı olarak hazine bonosu ve devlet tahvillerinden,

yurtiçinde ihraç edilmiş özel sektör tahvillerinden, finansman bonolarından ve kısa vadeli para piyasası araçlarından oluşur. Fon portföyü; yerli ve yabancı sermaye piyasası araçları ve vadeli işlemler piyasalarından enstrümanlara da yer veren bir dağılım ile hedefine ulaşmaya çalışır.

Fonun karşılaştırma ölçütü:

Fon Adı	Karşılaştırma Ölçütü
Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Birinci Değişken Emeklilik Yatırım Fonu	% 65 BIST – KYD DİBS 365 Gün Endeksi, % 10 BIST-100 Endeksi, % 10 BIST - KYD Repo Endeksi(Brüt), % 5 BIST - KYD ÖSBA Sabit Endeksi, %10 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi

Fon Portföyünde Yer Alacak Para ve Sermaye Piyasası Araçları:

VARLIK ve İŞLEM TÜRÜ	Asgari %	Azami %
Yerli/Yabancı Ortaklık Payları	0	30
Kamu İç Borçlanma Araçları	45	85
Kamu Dış Borçlanma Araçları	0	40
Özel Sektör Borçlanma Araçları (Yurtiçi)	0	20
Yabancı Kamu/Özel Sektör Borçlanma Araçları	0	20
Kamu/Özel Sektör Kira Sertifikaları	0	40
Gayrimenkule Dayalı Sermaye Piyasası Araçları	0	40
Gelire Endeksli Senetler (TL ve Döviz Cinsi) (Borsa İstanbul A.Ş.'ye kote olan)	0	40
Gelir Ortaklığı Senetleri	0	40
İpoteğe ve Varlığa Dayalı Menkul Kıymetler	0	40
İpotek ve varlık teminatlı menkul kıymetler	0	40
Vadeli Mevduat / Katılma Hesabı (TL / Döviz)*	0	25
Yatırım fonu katılma payları, yabancı yatırım fonu payları, borsa yatırım fonu katılma payları, gayrimenkul yatırım fonu katılım payları, girişim sermayesi yatırım fonu katılma payları ve yatırım ortaklığı payları	0	20
Yabancı Kamu/Özel Sektör Kira Sertifikaları	0	40
Altın ve Kıymetli Madenler İle Bunlara Dayalı Sermaye Piyasası Araçları	0	20
Yapılandırılmış Yatırım Aracı	0	10
Borsada İşlem Görmeyen Özel Sektör Borçlanma Araçları	0	10
Takasbank Para Piyasası Ve Yurtiçi Organize Para Piyasası İşlemleri	0	10
Ters Repo	0	10
Aracı kuruluş/ortaklık varantları	0	15

V. DÖNEM İÇİNDE ALINAN FON KURULU KARARLARI

01.01.2019 – 30.06.2019 tarihleri arasında olağan Fon Kurulu toplantıları gerçekleştirilmiş ve aşağıda belirtilen kararlar alınmıştır.

- 1- Ek kayda alma ücretinin fonlardan karşılanması,
- 2- 2018 Denetim raporu ve risk yönetim sistemi yeterliliğinin fon kuruluna sunulması,
- 3- 2018 yıllık raporların fon kuruluna sunulması,
- 4- Bağımsız şirketin seçilmesine ilişkin karar,

VI. 01.01.2019- 30.06.2019 TARİHLİ TÜREV İŞLEMLER

01.01.2019 – 30.06.2019 Tarih Aralığında 182 adet VOB işlemi yapılmıştır. Bu işlemlerden 1.352.152,50 TL gelir, 1.665.316,40 TL gider yazılmıştır.

Vadeli işlem Sözleşme Gelirleri	1,352,152.50
F_USDTRY0619	112,040.00
F_XU0300219	713,750.00
F_XU0300419	346,192.50
F_XU0300619	180,170.00

Vadeli işlem Sözleşme Giderleri	1,665,316.40
F_USDTRY0619	313,836.40
F_XU0300219	380,000.00
F_XU0300419	764,930.00
F_XU0300619	206,550.00

VII. FONUN İÇTÜZÜK, İZAHNAME VE TANITIM FORMU DEĞİŞİKLİKLERİ

Fonların içtüzük, izahname, tanıtım formu değişikliklerine ilişkin bilgilere <http://www.cignafinans.com.tr/bireysel-emeklilik/bireysel-emeklilik-yatirim-fonlari/SitePages/kamuyu-surekli-bilgilendirme-formlari.aspx> fonların kamuyu sürekli bilgilendirme sayfalarından ulaşılabilir.

Ece KAZCILAR
Fon Kurulu Üyesi

Elif BİLMEZ
Fon Kurulu Üyesi