

**CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**31 ARALIK 2019 HESAP DÖNEMİNE AİT
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA
UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**



**CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu’nun (“Fon”) Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan “Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına ilişkin Tebliğ (II-14.2)” hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca (“SPK”) belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu’nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Para Piyasası Emeklilik Yatırım Fonu’nun Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan “Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına ilişkin Tebliğ (II-14.2)” hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu’nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.’nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.


Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi



İstanbul, 28 Nisan 2020

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-2
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	3

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük					
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oran	Ödeme	Değer/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	
					Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oran	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	
A.HİSSE SENEDİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B.BORÇLANMA SENETLERİ																
Devlet Tahvili	T.C.	15.01.2020	TRT150120T32	0,00	0,00	2.500.000	94,23	20.09.2019	10,49	-	99,62	1,00	2.490.455	3,27	1,66	
	T.C.	15.01.2020	TRT150120T16	0,05	6,00	10.000.000	98,61	10.12.2019	293,39	-	104,84	1,00	10.484.488	13,77	6,97	
	T.C.	5.02.2020	TRT050220T17	0,04	6,00	5.200.000	102,04	26.12.2019	59,33	-	102,71	1,00	5.340.826	7,01	3,55	
	T.C.	13.05.2020	TRT130520T14	0,00	0,00	345.000	96,32	31.12.2019	10,67	-	96,37	1,00	332.493	0,44	0,22	
	T.C.	13.05.2020	TRT130520T14	0,00	0,00	1.800.000	96,15	26.12.2019	10,67	-	96,37	1,00	1.734.746	2,28	1,15	
	T.C.	10.06.2020	TRT100620T16	0,00	0,00	22.693.580	94,79	11.12.2019	11,00	-	95,50	1,00	21.672.889	28,46	14,41	
ARA TOPLAM						42.538.580							42.055.896			
Finansman Bonosu	QNB Finansbank A.Ş.	17.01.2020	TRFFNBK12034	0,00	0,00	1.750.000	96,97	25.10.2019	14,33	-	99,41	1,00	1.739.757	2,28	1,16	
		6.03.2020	TRFFNBK32024	0,00	0,00	2.500.000	97,53	13.12.2019	11,48	-	98,08	1,00	2.452.100	3,22	1,63	
	QNB Finans Yatırım	14.01.2020	TRFFNYM12024	0,00	0,00	1.500.000	96,42	15.10.2019	15,76	-	99,48	1,00	1.492.204	1,96	0,99	
	İş Yatırım	10.01.2020	TRFISMD12047	0,00	0,00	350.000	96,52	8.10.2019	13,81	-	99,68	1,00	348.885	0,46	0,23	
	Denizbank A.Ş.	11.03.2020	TRFDZBK32023	0,00	0,00	5.000.000	100,00	11.09.2019	(1,85)	-	100,36	1,00	5.017.957	6,59	3,34	
	Fibabanka A.Ş.	11.03.2020	TRFFIBA32017	0,00	3,00	3.000.000	100,00	11.09.2019	(3,16)	-	100,62	1,00	3.018.548	3,96	2,01	
		13.03.2020	TRFFNBK32016	0,00	3,00	5.000.000	100,00	13.09.2019	(4,67)	-	100,95	1,00	5.047.426	6,63	3,36	
		17.03.2020	TRFGRAN32011	0,00	1,00	1.880.000	100,00	12.12.2019	(4,11)	-	100,88	1,00	1.896.499	2,49	1,26	
	T.C. Ziraat Bankası A.Ş.	20.03.2020	TRFTCZB32026	0,00	3,00	1.980.000	100,00	20.09.2019	(5,42)	-	101,21	1,00	2.004.014	2,63	1,33	
	T.İş Bankası	5.03.2020	TRFTISB32010	0,00	3,00	7.000.000	100,00	12.09.2019	(3,11)	-	100,56	1,00	7.038.879	9,24	4,68	
	Yapı ve Kredi Bankası A.Ş.	13.03.2020	TRFYKKBK32021	0,00	1,00	3.000.000	100,00	20.09.2019	(5,48)	-	101,12	1,00	3.033.537	3,98	2,02	
		22.06.2020	TRFYKKBK62028	0,00	3,00	1.000.000	100,00	31.12.2019	(0,06)	-	100,03	1,00	1.000.307	1,31	0,67	
ARA TOPLAM						33.960.000							34.090.113			
GRUP TOPLAMI						76.498.580							76.146.009			
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
F.TERS REPO															
Devlet Tahvili Repo	T.C.	2.01.2020	TRT230222T13	0,11	-	20.041.233	212,02	26.12.2019	11,34	9.433.080,00	212,39	1,00	20.035.337	27,81	13,32
	T.C.	2.01.2020	TRT050220T17	0,11	-	500.308	99,56	31.12.2019	11,90	502.225,00	99,59	1,00	500.154	0,69	0,33
	T.C.	2.01.2020	TRT220921T18	0,11	-	19.512.021	96,27	31.12.2019	11,90	20.255.815,00	96,30	1,00	19.506.009	27,07	12,97
	T.C.	2.01.2020	TRT030523T13	0,11	-	15.509.555	182,29	31.12.2019	11,90	8.502.770,00	182,35	1,00	15.504.777	21,52	10,31
	T.C.	2.01.2020	TRT140623T19	0,11	-	4.502.774	110,15	31.12.2019	11,90	4.085.190,00	110,19	1,00	4.501.387	6,25	2,99
	T.C.	2.01.2020	TRT261022T10	0,11	-	12.007.397	200,50	31.12.2019	11,90	5.985.145,00	200,56	1,00	12.003.698	16,66	7,98
GRUP TOPLAMI						72.073.288							72.051.362		
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
H.VADELİ MEVDUAT	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
L.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI															
BPP	-	2.01.2020	-	0,11	-	146.087	100.000,00	31.12.2019	11,51	-	100.029,86	1,00	146.044	0,07	0,10
	-	2.01.2020	-	0,11	-	2.001.162	100.000,00	31.12.2019	11,18	-	100.029,04	1,00	2.000.581	0,91	1,33
	-	8.01.2020	-	0,11	-	55.133	100.000,00	31.12.2019	11,37	-	100.034,31	1,00	55.019	0,03	0,04
GRUP TOPLAMI						2.202.381							2.201.643		
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						150.774.249							150.399.014		

ÇİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
PARA PİYASASI EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2019			31 Aralık 2018		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	150.399.014	-	100,08	122.338.116	-	100,08
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	150.399.014	-	100,08	122.338.116	-	100,08
B,HAZIR DEĞERLER	7.775	-	0,01	2.410	-	0,00
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	7.775	100,00	0,01	2.410	100,00	-
C,ALACAKLAR	0	0,00	0,00	-	-	-
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	0,00	0,00	-	-	-
E,BORÇLAR	128.422	0,00	0,00	95.638	-	-
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	101.605	79,12	-	82.018	85,76	-
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	26.817	20,88	-	13.620	14,24	-
i) Denetim Ücreti	19.787	15,41	-	12.839	13,42	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	4.508	3,51	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Diğer	2.521	1,96	-	781	0,82	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	0,00	0,00	-	-	-
Fon toplam değeri	150.278.368			122.244.888		