

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS KATILIM STANDART 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.
OKS KATILIM STANDART 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. OKS Katılım Standart 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. OKS Katılım Standart 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.
OKS KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-3
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	4

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS KATILIM STANDART 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			Toplam	Grup	Toplam
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Deger	Deger	(%)	(%)
A.HİSSE SENEDİ																
Hisse Senedi	ALKIM	-	ALKIM	-	-	710	24,46	23.10.2019	-	-	38,32	1,00	27.207	8,18	0,15	
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	1.373	40,02	5.07.2019	-	-	46,66	1,00	64.064	19,26	0,36	
	EREGL	-	EREGL	-	-	9.000	6,66	6.09.2019	-	-	9,04	1,00	81.360	24,46	0,46	
	FROTO	-	FROTO	-	-	500	61,71	29.11.2018	-	-	70,85	1,00	35.425	10,65	0,20	
	KERVİT	-	KERVİT	-	-	22.864	2,61	21.10.2019	-	-	3,26	1,00	74.537	22,41	0,42	
	MAVİ	-	MAVİ	-	-	545	36,07	5.07.2019	-	-	57,90	1,00	31.556	9,49	0,18	
	SELEC	-	SELEC	-	-	3.028	3,43	1.04.2019	-	-	6,10	1,00	18.471	5,55	0,10	
	YATAS	-	YATAS	-	-	1	7,59	8.06.2018	-	-	7,34	1,00	4	0,00	0,00	
GRUP TOPLAMI						38.021							332.623			
B.BORÇLANMA SENETİ																
Kira Sertifikaları	T.C.	10.01.2020	TRDBRKT12015	0,04	3,00	300.000	100,00	4.10.2019	7.130,43	-	103,51	1,00	310.536	2,73	1,74	
	T.C.	14.01.2020	TRDZKVK12023	0,03	3,00	50.000	100,00	11.10.2019	1.504,86	-	103,08	1,00	51.542	0,45	0,29	
	T.C.	30.01.2020	TRDVVRK12043	0,03	3,00	500.000	100,00	24.10.2019	277,06	-	102,56	1,00	512.780	4,51	2,87	
	T.C.	4.02.2020	TRDHVKA22013	0,05	4,00	400.000	100,00	8.10.2019	181,63	-	103,24	1,00	412.957	3,63	2,31	
	T.C.	12.02.2020	TRD120220T16	0,06	6,00	30.000	101,67	27.06.2019	81,31	-	105,26	1,00	31.578	0,28	0,18	
	T.C.	21.02.2020	TRDZKVK22014	0,03	3,00	450.000	100,00	15.11.2019	106,48	-	101,77	1,00	457.960	4,02	2,56	
	T.C.	19.03.2020	TRDNVKA32010	0,07	6,00	400.000	100,00	4.10.2019	52,72	-	103,80	1,00	415.216	3,65	2,32	
	T.C.	17.04.2020	TRDKTLM42012	0,05	12,00	100.000	100,00	20.04.2018	0,00	-	106,00	1,00	106.005	0,93	0,59	
	T.C.	17.06.2020	TRDKTLM62010	0,03	3,00	200.000	99,13	21.06.2019	48,36	-	100,07	1,00	200.149	1,76	1,12	
	T.C.	23.09.2020	TRD230920T24	0,12	6,00	1.940.000	106,39	16.09.2019	9,45	-	116,48	1,00	2.259.710	19,86	12,65	
	T.C.	18.11.2020	TRD181120T19	0,09	6,00	1.300.000	101,81	9.09.2019	10,05	-	108,35	1,00	1.408.494	12,38	7,88	
	T.C.	10.02.2021	TRD100221T17	0,09	6,00	1.740.000	106,35	27.11.2019	2,95	-	113,85	1,00	1.981.050	17,41	11,09	
	T.C.	16.06.2021	TRD160621T17	0,11	6,00	1.280.000	111,64	18.12.2019	3,00	-	116,00	1,00	1.484.764	13,05	8,31	
	T.C.	14.07.2021	TRD140721T18	0,05	6,00	1.680.000	87,99	16.12.2019	3,34	-	104,02	1,00	1.747.601	15,36	9,78	
GRUP TOPLAMI						10.370.000							11.380.344			

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS KATILIM STANDART 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 (%)
C. KATILMA BELGESİ															
Katılma Belgesi	-	-	OGM	-	-	319.635	1,06	2.10.2019	-	-	1,08	1,00	344.158	16,31	1,93
	-	-	AG6	-	-	240	1.125,85	13.06.2019	-	-	1.170,20	1,00	280.848	13,31	1,57
	-	-	PYG	-	-	360.000	1,07	25.12.2019	-	-	1,21	1,00	436.863	20,70	2,45
	-	-	IKG	-	-	150.000	1,00	19.12.2018	-	-	1,17	1,00	176.099	8,35	0,99
	-	-	ICI	-	-	150.000	1,00	19.12.2018	-	-	1,17	1,00	175.881	8,33	0,98
	-	-	ICI	-	-	170.570	1,17	31.12.2019	-	-	1,17	1,00	200.000	9,48	1,12
	-	-	RP4	-	-	386	1.195,26	13.12.2019	-	-	1.285,90	1,00	496.357	23,52	2,78
GRUP TOPLAMI						1.150.831	2.110.207								
D.OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
G.KATILIM HESABI															
Katılım Hesabı	Ziraat Katılım	10.02.2020	-	0,17	-	314.032	100,00	8.08.2019	0,00	-	106,72	1,00	335.135	8,29	1,88
	Ziraat Katılım	21.02.2020	-	0,16	-	200.000	100,00	21.08.2019	0,00	-	105,65	1,00	211.296	5,23	1,18
	Vakıf Katılım B	28.02.2020	-	0,12	-	189.986	100,00	22.08.2019	0,00	-	104,32	1,00	198.197	4,90	1,11
	Ziraat Katılım	26.03.2020	-	0,16	-	96.247	100,00	5.09.2019	0,00	-	105,11	1,00	101.163	2,50	0,57
	Vakıf Katılım B	6.04.2020	-	0,15	-	86.557	100,00	11.09.2019	0,00	-	104,51	1,00	90.458	2,24	0,51
	Vakıf Katılım B	6.04.2020	-	0,15	-	98.208	100,00	25.09.2019	0,00	-	103,94	1,00	102.081	2,53	0,57
	Vakıf Katılım B	30.06.2020	-	0,14	-	80.000	100,00	11.10.2019	0,00	-	103,22	1,00	82.579	2,04	0,46
	Vakıf Katılım B	10.01.2020	-	0,11	-	200.000	100,00	14.11.2019	0,00	-	101,43	1,00	202.862	5,02	1,14
	Ziraat Katılım	28.02.2020	-	0,12	-	44.083	100,00	27.11.2019	0,00	-	101,13	1,00	44.582	1,10	0,25
	Vakıf Katılım B	28.02.2020	-	0,12	-	642.095	100,00	27.11.2019	0,00	-	101,15	1,00	649.452	16,07	3,64
	Türkiye Emlak K	24.01.2020	-	0,11	-	300.000	100,00	11.12.2019	0,00	-	100,62	1,00	301.872	7,47	1,69
	Türkiye Emlak K	24.01.2020	-	0,11	-	100.000	100,00	19.12.2019	0,00	-	100,39	1,00	100.386	2,48	0,56
	Türkiye Emlak K	28.07.2020	-	0,15	-	170.000	100,00	31.12.2019	0,00	-	100,04	1,00	170.070	4,21	0,95
	Türkiye Emlak K	14.02.2020	-	0,11	-	718.359	100,00	31.12.2019	0,00	-	100,03	1,00	718.571	17,78	4,02
	Ziraat Katılım	14.02.2020	-	0,10	-	217.475	100,00	31.12.2019	0,00	-	100,03	1,00	217.534	5,38	1,22
	Vakıf Katılım B	14.02.2020	-	0,10	-	514.856	100,00	31.12.2019	0,00	-	100,03	1,00	515.000	12,74	2,88
GRUP TOPLAMI						3.971.897	4.041.238								

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS KATILIM STANDART 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 Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
H.VADELİ MEVDUAT	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
L.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						15.530.749	17.864.412								

ÇİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS KATILIM STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ

(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	17.864.412	-	99,20	7.145.069	-	99,19
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	13.823.175	-	76,76	7.145.069	-	99,19
B,HAZIR DEĞERLER	158.353	-	0,88	67.932	-	0,94
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	158.353	100,00	0,88	67.932	100,00	0,94
C,ALACAKLAR	0	0,00	0,00	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	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	14.805	0,00	0,00	9.396	0,00	0,00
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	12.797	86,43	-	5.867	60,53	-
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	2.009	13,57	-	3.709	39,47	-
i) Denetim Ücreti	815	5,50	-	3.540	37,67	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	540	3,65	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Diğer	654	4,42	-	169	1,80	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	0,00	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	18.007.959			7.203.605		