

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS ATAK DEĞİŞKEN 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 ATAK DEĞİŞKEN 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 Atak Değişken 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 Atak Değişken 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 ATAĞ DEĞİŞKEN 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.
OKS ATAĞ DEĞİŞKEN 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	Faiz Ödeme	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış	Satın Alış	İç İskonto	Repo Teminat	Günlük Birim	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı		Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger		Deger		
A.HİSSE SENEDİ															
Hisse Senedi	AKBNK	-	AKBNK	-	-	3.010	7,26	6.11.2019	-	-	8,11	1,00	24.411	6,84	3,20
	ALKIM	-	ALKIM	-	-	480	31,12	20.11.2019	-	-	38,32	1,00	18.394	5,15	2,41
	ANACM	-	ANACM	-	-	6.170	3,06	6.11.2019	-	-	4,36	1,00	26.901	7,53	3,53
	AYGAZ	-	AYGAZ	-	-	1.400	12,54	20.12.2019	-	-	12,84	1,00	17.976	5,03	2,36
	EREGL	-	EREGL	-	-	2.400	7,33	13.11.2019	-	-	9,04	1,00	21.696	6,08	2,84
	GARAN	-	GARAN	-	-	2.804	9,47	6.11.2019	-	-	11,14	1,00	31.237	8,75	4,10
	GLDTR	-	GLDTR	-	-	970	17,70	27.08.2019	-	-	26,06	1,00	25.273	7,08	3,31
	GMSTR	-	GMSTR	-	-	1.100	21,06	2.10.2019	-	-	22,65	1,00	24.916	6,98	3,27
	ISCTR	-	ISCTR	-	-	2.670	5,97	6.11.2019	-	-	6,41	1,00	17.115	4,79	2,24
	KERVT	-	KERVT	-	-	5.590	2,75	13.12.2019	-	-	3,26	1,00	18.223	5,10	2,39
	OTKAR	-	OTKAR	-	-	150	130,67	6.11.2019	-	-	159,00	1,00	23.850	6,68	3,13
	PGSUS	-	PGSUS	-	-	340	60,76	6.11.2019	-	-	86,40	1,00	29.376	8,23	3,85
	TKFEN	-	TKFEN	-	-	600	19,31	20.11.2019	-	-	19,32	1,00	11.592	3,25	1,52
	TOASO	-	TOASO	-	-	660	22,12	6.11.2019	-	-	26,86	1,00	17.728	4,96	2,32
	ULKER	-	ULKER	-	-	1.090	19,11	6.11.2019	-	-	22,36	1,00	24.372	6,82	3,20
	USDTR	-	USDTR	-	-	42	521,57	25.10.2019	-	-	572,59	1,00	24.049	6,73	3,15
GRUP TOPLAMI						29.476							357.109		
B.BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili	T.C.	13.05.2020	TRT130520T14	0,00	0,00	30.000	79,41	15.05.2019	10,67	-	96,37	1,00	28.912	7,76	3,79
	T.C.	16.09.2020	TRT160920T25	0,00	0,00	100.000	89,85	31.10.2019	11,31	-	92,68	1,00	92.680	24,89	12,15
	T.C.	7.10.2020	TRT071020T23	0,00	0,00	100.000	90,20	13.11.2019	11,27	-	92,13	1,00	92.132	24,74	12,08
ARA TOPLAM						230.000							213.725		
Özel Sektör Tahvil	Yapi Kredi Yatırım	4.08.2021	TRSAYGZ82118	0,04	3,00	14.000	100,00	7.08.2019	10,26	-	102,20	1,00	14.308	3,84	1,88
	İş GYO A.Ş.	25.01.2021	TRSIJSGY12113	0,04	3,00	10.000	100,00	28.01.2019	20,95	-	103,24	1,00	10.324	2,77	1,35
ARA TOPLAM						24.000							24.632		
Finansman Bonosu	ALTERNATİF YATIRI	4.02.2020	TRFALNF22017	0,00	0,00	50.000	97,01	6.11.2019	13,10	-	98,86	1,00	49.430	13,27	6,48
	QNB Finansbank A.Ş.	17.01.2020	TRFFNBK12034	0,00	0,00	55.000	96,97	25.10.2019	14,33	-	99,41	1,00	54.678	14,68	7,17
	İş Yatırım	10.01.2020	TRFISMD12047	0,00	0,00	30.000	96,52	8.10.2019	13,81	-	99,68	1,00	29.904	8,03	3,92
ARA TOPLAM						135.000							134.012		
GRUP TOPLAMI						389.000							372.369		

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS ATAĞ DEĞİŞKEN 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
H.VADELİ MEVDUAT															
Vadeli Mevduat (TL)	AKBANK T.A.Ş.	17.01.2020	-	0,12	-	25.000	100,00	9.12.2019	0,00	-	100,74	1,00	25.184	100,00	3,30
GRUP TOPLAMI						25.000							25.184		
I.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI															
BPP	-	2.01.2020	-	0,11	-	8.005	100.000,00	31.12.2019	11,62	-	100.030,13	1,00	8.002	100,00	1,05
GRUP TOPLAMI						8.005							8.002		
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFOY DEĞERİ						451.481							762.664		

ÇİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS ATAK DEĞİŞKEN 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	762.664	-	100,88	602.263	-	99,93
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	762.665	-	100,88	602.263	-	99,93
B,HAZIR DEĞERLER	1.519	-	0,20	2.476	-	0,41
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	1.519	100,00	0,20	2.476	100,00	0,41
C,ALACAKLAR	5.165	0,00	0,68	5.351	0,00	0,89
a) Takastan Alacaklar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-	-	-	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	5.165	100,00	1,37	5.351	100,00	1,78
D,DİĞER VARLIKLAR	0	0,00	0,00	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	13.360	0,00	0,00	7.395	0,00	0,00
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	533	3,99	-	433	5,86	-
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	12.827	96,01	-	6.962	94,14	-
i) Denetim Ücreti	5.310	39,74	-	3.540	47,87	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	-	-	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Diğer	7.517	56,27	-	3.422	46,27	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	0,00	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	755.988			602.695		