

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS 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 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 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 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 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 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	Faiz Ödeme	Nominal Deger/	Birim Alış	Satın Alış	İç İskonto	Repo Teminat	Günlük Birim	Günlük Kur	Toplam	Grup	Toplam		
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)		
A.HİSSE SENEDİ																	
Hisse Senedi	GLDTR	-	GLDTR	-	-	26.100	20,91	26.04.2019	-	-	26,06	1,00	680.036	100,00	2,49		
	TRKCM	-	TRKCM	-	-	1	4,15	8.06.2018	-	-	3,50	1,00	2	0,00	0,00		
GRUP TOPLAMI						26.101									680.037		
B.BORÇLANMA SENETLERİ																	
Devlet Tahvili	T.C.	15.01.2020	TRT150120T32	0,00	0,00	500.000	93,18	6.08.2019	10,49	-	99,62	1,00	498.091	2,66	1,83		
	T.C.	15.01.2020	TRT150120T16	0,05	6,00	2.848.000	94,94	15.05.2019	293,39	-	104,84	1,00	2.985.982	15,95	10,95		
	T.C.	5.02.2020	TRT050220T17	0,04	6,00	2.100.000	87,43	10.05.2019	59,33	-	102,71	1,00	2.156.872	11,52	7,91		
	T.C.	13.05.2020	TRT130520T14	0,00	0,00	3.529.000	83,12	1.10.2019	10,67	-	96,37	1,00	3.401.065	18,17	12,47		
	T.C.	10.06.2020	TRT100620T16	0,00	0,00	2.180.000	86,60	11.12.2019	11,00	-	95,50	1,00	2.081.950	11,12	7,63		
	T.C.	8.07.2020	TRT080720T19	0,05	6,00	1.640.000	86,80	2.04.2019	10,33	-	103,97	1,00	1.705.145	9,11	6,25		
	T.C.	12.08.2020	TRT120820T12	0,12	6,00	30.118	112,89	14.11.2018	9,84	-	116,12	1,00	34.972	0,19	0,13		
	T.C.	12.08.2020	TRT120820T12	0,12	6,00	80.000	113,35	3.07.2019	9,84	-	116,12	1,00	92.892	0,50	0,34		
	T.C.	16.09.2020	TRT160920T25	0,00	0,00	250.000	85,30	3.09.2019	11,31	-	92,68	1,00	231.701	1,24	0,85		
	T.C.	7.10.2020	TRT071020T23	0,00	0,00	2.000.000	90,09	13.11.2019	11,27	-	92,13	1,00	1.842.639	9,84	6,76		
	T.C.	17.02.2021	TRT170221T12	0,05	6,00	1.400.000	95,20	9.12.2019	6,16	-	103,46	1,00	1.448.450	7,74	5,31		
	T.C.	12.01.2022	TRT120122T17	0,05	6,00	200.000	82,44	25.01.2019	3,98	-	101,14	1,00	202.279	1,08	0,74		
	T.C.	17.08.2022	TRT170822T15	0,05	6,00	150.000	80,38	27.03.2019	3,04	-	102,31	1,00	153.467	0,82	0,56		
ARA TOPLAM						16.907.118									16.835.504		
Özel Sektör Tahvil	Arçelik	16.07.2021	TRSARCL72112	0,04	3,00	250.000	103,11	28.08.2019	11,74	-	102,80	1,00	256.995	1,37	0,94		
	HAYAT VARLIK YÖNETİM A.Ş.	4.02.2020	TRSHYTV22012	0,05	3,00	200.000	99,64	7.12.2018	317,86	-	102,81	1,00	205.625	1,10	0,75		
ARA TOPLAM						450.000									462.620		
Finansman Bonosu	QNB Finansbank A.Ş.	17.01.2020	TRFFNBK12034	0,00	0,00	300.000	96,97	25.10.2019	14,33	-	99,41	1,00	298.244	1,59	1,09		
		6.03.2020	TRFFNBK32024	0,00	0,00	100.000	97,53	13.12.2019	11,48	-	98,08	1,00	98.084	0,52	0,36		
	QNB Finans Yatırım	14.01.2020	TRFFNYM12024	0,00	0,00	100.000	96,42	15.10.2019	15,76	-	99,48	1,00	99.480	0,53	0,36		
		12.02.2020	TRFYKYM22053	0,00	0,00	350.000	98,09	10.12.2019	11,54	-	98,75	1,00	345.627	1,85	1,27		
	Denizbank A.Ş.	4.03.2020	TRFDZBK32015	0,00	3,00	100.000	100,00	4.09.2019	(9,33)	-	101,71	1,00	101.706	0,54	0,37		
	T.C. Ziraat Bankası A.Ş.	6.03.2020	TRFTCZB32018	0,00	3,00	390.000	100,00	6.09.2019	(7,70)	-	101,44	1,00	395.607	2,11	1,45		
	T.C. Ziraat Bankası A.Ş.	27.08.2020	TRFTCZB82013	0,00	3,00	80.000	100,00	29.08.2019	(3,30)	-	102,22	1,00	81.778	0,44	0,30		
ARA TOPLAM						1.420.000									1.420.526		
GRUP TOPLAMI						18.777.118									18.718.650		

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS 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	-	-	FUB EurobondFon	-	-	8.896.319	0,06	24.07.2019	-	-	0,07	1,00	613.277	14,89	2,25
	-	-	OGM	-	-	470.735	1,06	12.09.2019	-	-	1,08	1,00	506.851	12,30	1,86
	-	-	RP4	-	-	220	1.273,19	20.08.2019	-	-	1.285,90	1,00	282.898	6,87	1,04
	-	-	TUA	-	-	5.600.178	0,06	9.05.2019	-	-	0,07	1,00	392.892	9,54	1,44
	-	-	BGY	-	-	358.689	1,26	22.10.2018	-	-	1,41	1,00	504.094	12,24	1,85
	-	-	AGN	-	-	337.987	1,33	22.10.2018	-	-	1,73	1,00	584.924	14,20	2,14
	-	-	ISZ	-	-	386.000	1,09	7.09.2018	-	-	1,32	1,00	509.376	12,36	1,87
	-	-	IAG	-	-	538.000	1,17	19.12.2019	-	-	1,35	1,00	725.760	17,62	2,66
GRUP TOPLAMI						16.588.128	4.120.071								
D.OPSİYON İŞLEMLER															
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE															
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO															
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
G.KATILIM HESABI															
Katılım Hesabi	VAKIF KATILIM B	22.06.2020	-	0,14	-	220.870	100,00	11.12.2019	0,00	-	100,82	1,00	222.671	100,00	0,82
GRUP TOPLAMI						220.870	222.671								
H.VADELİ MEVDUAT															
Vadeli Mevduat (TL)	DENİZBANK KURUM	5.02.2020	-	0,17	-	250.000	100,00	5.08.2019	0,00	-	106,98	1,00	267.455	7,63	0,98
	ANADOLU BANK A.	26.02.2020	-	0,16	-	100.000	100,00	26.08.2019	0,00	-	105,54	1,00	105.544	3,01	0,39
	ANADOLU BANK A.	30.03.2020	-	0,14	-	66.000	100,00	30.09.2019	0,00	-	103,45	1,00	68.275	1,95	0,25
	ANADOLU BANK A.	6.05.2020	-	0,13	-	90.000	100,00	7.10.2019	0,00	-	103,05	1,00	92.744	2,65	0,34
	FİNANSBANK MERK	1.06.2020	-	0,11	-	95.328	100,00	8.11.2019	0,00	-	101,59	1,00	96.847	2,76	0,36
	DENİZBANK KURUM	15.01.2020	-	0,11	-	104.941	100,00	11.12.2019	0,00	-	100,65	1,00	105.627	3,01	0,39
	AKBANK T.A.Ş.	31.01.2020	-	0,11	-	156.876	100,00	24.12.2019	0,00	-	100,23	1,00	157.231	4,48	0,58
	VAKIFBANK ETİLE	10.02.2020	-	0,10	-	507.384	100,00	27.12.2019	0,00	-	100,14	1,00	508.093	14,49	1,86
	ANADOLU BANK A.	29.06.2020	-	0,10	-	270.000	100,00	27.12.2019	0,00	-	100,12	1,00	270.334	7,71	0,99
	ANADOLU BANK A.	10.02.2020	-	0,10	-	284.688	100,00	27.12.2019	0,00	-	100,14	1,00	285.087	8,13	1,05
	TEB A.Ş.	10.02.2020	-	0,10	-	566.186	100,00	27.12.2019	0,00	-	100,13	1,00	566.948	16,17	2,08
	DENİZBANK KURUM	24.07.2020	-	0,10	-	980.484	100,00	27.12.2019	0,00	-	100,12	1,00	981.700	28,00	3,60
GRUP TOPLAMI						3.471.887	3.505.884								
I.KIYMETLİ MADEN															
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL															
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI															
BPP	-	2.01.2020	-	0,11	-	23.014	100.000,00	31.12.2019	11,51	-	100.029,87	1,00	23.007	100,00	0,08
GRUP TOPLAMI						23.014	23.007								

CİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS 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				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz	Ödeme	Değer/	Alış	Alış	İskonto	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
				Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	Tutar	Değer	Kur	Değer	(%)	(%)
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						39.107.118							27.270.321		

ÇİGNA FİNANS EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS STANDART 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	27.270.321	-	100,08	14.218.372	-	100,07
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	27.047.651	-	99,26	14.218.372	-	100,07
B,HAZIR DEĞERLER	1.929	-	0,01	5.249	-	0,04
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
i) TL Hesaplar	-	-	-	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-	-	-	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hızır Değerler	1.929	100,00	0,01	5.249	100,00	0,04
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	22.537	0,00	0,00	14.589	0,00	0,00
a) Takasa Borçlar T1	-	-	-	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	-	-	-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	19.449	86,30	-	10.880	74,58	-
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	3.087	13,70	-	3.709	25,42	-
i) Denetim Ücreti	1.616	7,17	-	3.540	24,26	-
ii) İlan Giderleri	-	-	-	-	-	-
iii) Noter Masrafı	-	-	-	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	817	3,63	-	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	-	-	-	-	-	-
vi) Diğer	654	2,90	-	169	1,16	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	0,00	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	27.249.713			14.209.032		