

CİGNA SAĞLIK HAYAT A.Ş.
KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.
Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 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 SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KAMU BORÇLANMA
ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU**
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Kamu Borçlanma Araçları
Emeklilik Yatırım Fonu”)

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

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

				Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç		Borsa	Repo	Günlük											
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto		Sözleşme	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	F.T.D		Stok				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı		No	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	(%)	Depo	VKG	Depo			
A.HİSSE SENEDİ																								
Hisse Senedi	ARZUM	-	ARZUM	-	-	86	17,00	23.12.2020	-		-	-	24,62	1	2.117	0,02	0,00	0,00	SRB	0	-			
	GARAN	-	GARAN	-	-	200.000	9,79	23.12.2020	-		-	-	10,37	1	2.074.000	21,33	0,65	0,65	SRB	0	-			
	ISMEN	-	ISMEN	-	-	220.294	13,34	10.12.2020	-		-	-	17,66	1	3.890.392	40,01	1,22	1,22	SRB	0	-			
	KRDMD	-	KRDMD	-	-	650.000	5,25	16.12.2020	-		-	-	5,78	1	3.757.000	38,64	1,18	1,18	SRB	0	-			
GRUP TOPLAMI						1.070.380											9.723.509		3,05	3,04				
B.BORÇLANMA SENETLERİ																								
Devlet Tahvili	T.C.	17.02.2021	TRT170221T12	0,05	6	22.500.000	98,53	5.02.2020	69,06		-	-	103,46	1	23.279.126	8,00	7,30	7,28	SRB	48 FNY				
	T.C.	21.04.2021	TRT210421T14	0,10	6	13.000.000	114,73	15.01.2020	55,89		-	-	105,76	1	13.748.634	4,72	4,31	4,30	SRB	111 FNY				
	T.C.	21.07.2021	TRT210721T11	0,02	6	3.000.000	251,49	25.09.2020	0,00		-	-	262,66	1	7.879.776	2,71	2,47	2,46	SRB	20 FNY				
	T.C.	22.09.2021	TRT220921T18	0,05	6	24.000.000	93,28	3.09.2020	15,90		-	-	98,14	1	23.554.298	8,09	7,39	7,37	SRB	83 FNY				
	T.C.	12.01.2022	TRT120122T17	0,05	6	12.300.000	86,21	15.01.2020	10,21		-	-	99,06	1	12.184.889	4,19	3,82	3,81	SRB	13 FNY				
	T.C.	2.03.2022	TRT020322T17	0,06	6	5.000.000	80,42	3.09.2020	9,95		-	-	99,39	1	4.969.584	1,71	1,56	1,55	SRB	426 FNY				
	T.C.	20.04.2022	TRT200422T14	0,04	6	14.000.000	96,82	16.09.2015	7,14		-	-	99,76	1	13.966.560	4,80	4,38	4,37	SRB	111				
	T.C.	17.08.2022	TRT170822T15	0,05	6	13.200.000	80,80	6.11.2018	7,47		-	-	98,48	1	12.998.841	4,47	4,08	4,07	SRB	594 FNY				
	T.C.	14.09.2022	TRT140922T17	0,04	6	15.500.000	95,21	3.09.2020	8,81		-	-	93,99	1	14.567.766	5,00	4,57	4,56	SRB	76 FNY				
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	0,06	6	21.000.000	100,32	23.06.2020	4,52		-	-	102,50	1	21.525.174	7,39	6,75	6,73	SRB	748 FNY				
	T.C.	8.03.2023	TRT080323T10	0,04	6	13.400.000	72,20	12.10.2018	8,40		-	-	89,82	1	12.035.885	4,13	3,78	3,76	SRB	69 FNY				
	T.C.	14.06.2023	TRT140623T19	0,08	6	7.400.000	93,02	19.03.2019	4,10		-	-	105,31	1	7.792.712	2,68	2,44	2,44	SRB	895 FNY				
	T.C.	27.09.2023	TRT270923T11	0,04	6	6.000.000	75,99	17.12.2018	6,64		-	-	91,26	1	5.475.436	1,88	1,72	1,71	SRB	90 FNY				
	T.C.	20.03.2024	TRT200324T13	0,05	6	5.900.000	70,26	5.09.2018	4,74		-	-	95,11	1	5.611.663	1,93	1,76	1,76	SRB	83 FNY				
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	0,05	6	12.500.000	91,71	20.11.2020	4,68		-	-	92,61	1	11.576.764	3,98	3,63	3,62	SRB	27 FNY				
	T.C.	12.03.2025	TRT120325T12	0,04	6	4.000.000	66,36	31.01.2019	5,36		-	-	86,76	1	3.470.392	1,19	1,09	1,09	SRB	76 FNY				
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	0,05	6	43.500.000	94,78	7.12.2020	2,57		-	-	97,14	1	42.255.100	14,52	13,25	13,22	SRB	48 FNY				
	T.C.	24.02.2027	TRT240227T17	0,06	6	15.500.000	92,51	20.10.2020	2,21		-	-	97,02	1	15.037.401	5,17	4,72	4,70	SRB	2246 FNY				
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	0,05	6	9.000.000	93,27	19.11.2020	2,29		-	-	95,15	1	8.563.196	2,94	2,69	2,68	SRB	2414 FNY				
	T.C.	8.03.2028	TRT080328T15	0,06	6	2.400.000	96,31	7.07.2020	1,24		-	-	102,90	1	2.469.490	0,85	0,77	0,77	SRB	2624 FNY				
	T.C.	13.11.2030	TRT131130T14	0,12	2	4.500.000	95,13	18.12.2020	1,48		-	-	96,60	1	4.346.874	1,49	1,36	1,36	SRB	3604 FNY				
ARA GRUP TOPLAMI						267.600.000											267.309.561		83,85	83,61				

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Ödeme	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Günlük		Toplam	Grup	Toplam	F.T.D		Stok			
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Faiz	Sayı	Kontrat Sayısı	Alış	Alış	İskonto	Sözleşme	Teminat	Birim	Kur	Deger	(%)	(%)	(%)	Depo	VKG	Depo		
Özel Sektör Tahvil	Ereğli Demir ve Çelik Fabrikaları T.A.Ş	28.05.2021	TRSERGL52117	0,03	3		700.000	102,65	28.05.2020	73,65	-	-	101,60	1	711.229	0,24	0,22	0,22	SRB	148	FNY		
	Yapı Kredi Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	22.01.2021	TRSTPRS12115	0,04	3		2.400.000	101,56	1.06.2020	3.128,37	-	-	102,59	1	2.462.090	0,85	0,77	0,77	SRB	22	FNY		
ARA GRUP TOPLAMI							3.100.000								3.173.319		1,00	0,99					
Kira Sertifikaları	T.C.	10.02.2021	TRD100221T17	0,09	2		2.500.000	100,28	19.02.2019	921,58	-	-	107,20	1	2.680.090	0,92	0,84	0,84	SRB	41	FNY		
ARA GRUP TOPLAMI							2.500.000								2.680.090		0,84	0,84					
Finansman Bonosu	-	10.06.2021	TRFDZBK62111	0,00	0		2.000.000	91,35	11.06.2020	20,02	-	-	92,31	1	1.846.263	0,63	0,58	0,58	SRB	161	AAA		
	-	5.05.2021	TRFH5BC52115	0,00	0		6.150.000	92,06	7.10.2020	19,42	-	-	94,15	1	5.790.088	1,99	1,82	1,81	SRB	125	AAA		
ARA GRUP TOPLAMI							8.150.000								7.636.351		2,40	2,39					
Banka Bonosu	-	21.01.2022	TRSDZBK12226	0,00	0		1.500.000	85,91	8.07.2020	10,36	-	-	90,12	1	1.351.807	0,46	0,42	0,42	SRB	386	AAA		
	-	5.03.2021	TRFTEBK32115	0,02	3		7.000.000	100,00	5.06.2020	76,26	-	-	99,20	1	6.944.291	2,39	2,18	2,17	SRB	64	AAA		
	-	12.03.2021	TRFTEBK32123	0,02	3		2.000.000	100,00	12.06.2020	55,35	-	-	100,54	1	2.010.749	0,69	0,63	0,63	SRB	71	AAA		
ARA GRUP TOPLAMI							10.500.000								10.306.847		3,23	3,22					
GRUP TOPLAMI							291.850.000								291.106.169		91,31	91,06					
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
F.TERS REPO																							
Devlet Tahvili Repo	T.C.	4.01.2021	TRT070727T13	0,18	-		8.015.693	164,02	31.12.2020	19,58	A3B6902000FCB8F	4.877.510	164,10	1	8.003.920	100,00	2,51	2,50	SRB	4	FNY		
GRUP TOPLAMI							8.015.693								8.003.920		2,51	2,50					
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
H.VADELİ MEVDUAT																							
Vadeli Mevduat (TL)	BURGAN BANK A.Ş	18.01.2021	-	0,17	-		7.000.000	100,00	15.12.2020	0,00	-	-	100,81	1	7.056.670	100,00	2,21	2,21	SRB	18	AAA		
GRUP TOPLAMI							7.000.000								7.056.670		2,21	2,21					
L.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
K.BORSA PARA PİYASASI																							
BPP	-	4.01.2021	-	0,18	-		144.282	100.000,00	31.12.2020	19,52	-	-	100.048,87	1	144.070	16,86	0,05	0,05	-	4	FNY		
	-	4.01.2021	-	0,18	-		711.385	100.000,00	31.12.2020	19,46	-	-	100.048,73	1	710.346	83,14	0,22	0,22	-	4	FNY		
GRUP TOPLAMI							855.667								854.416		0,27	0,27					

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

			Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Günlük								
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Sözleşme	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	F.T.D			Stok
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	No	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	(%)	Depo	VKG	Depo
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																				
VIOP Nakit	-	-	-	-	-	2.066.165	1,00	19.11.2020	-	-	-	1,00	1	2.066.165	100,00	0,65	0,65	-	0	-
GRUP TOPLAMI						2.066.165								2.066.165		0,65	0,65			
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						310.857.905								318.810.850					0	

**CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Kamu Borçlanma Araçları Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

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

	31 Aralık 2020			31 Aralık 2019		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	318.810.850	-	99,72	338.706.711	-	100,14
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	318.810.850	-	99,72	338.706.711	-	100,14
B,HAZIR DEĞERLER	1.620	-	0,00	1.648	-	-
a) Kasa	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Bankalar	0	0,00	0,00	-	-	-
i) TL Hesaplar	0	0,00	0,00	-	-	-
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	0	0,00	0,00	-	-	-
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	0	0,00	0,00	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	1.620	100,00	0,00	1.648	100,00	-
C,ALACAKLAR	5.817.938	-	0,02	4.442.783	0,00	1,31
a) Takastan Alacaklar T1	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	1.375.000	23,63	0,86	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0	0,00	0,00	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	4.442.938	76,37	2,78	4.442.783	100,00	2,63
D,DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	4.930.587	-	0,00	4.915.077	0,00	0,00
a) Takasa Borçlar T1	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00	0,00	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	395.015	8,01	0,00	416.305	8,47	-
d) Ödenecek Vergi	0	0,00	0,00	-	-	-
e) İhtiyatlar	0	0,00	0,00	-	-	-
f) Krediler	0	0,00	0,00	-	-	-
g) Diğer Borçlar	4.535.572	91,99	0,00	4.498.772	91,53	-
i) Denetim Ücreti	82.398	1,67	0,00	44.529	0,91	-
ii) İlan Giderleri	0	0,00	0,00	-	-	-
iii) Noter Masrafı	0	0,00	0,00	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	9.592	0,19	0,00	10.147	0,21	-
v) Takas Saklama Komisyonu	0	0,00	0,00	-	-	-
vi) Diğer	4.443.583	90,12	0,00	4.444.096	90,42	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	319.699.820			338.236.066		