

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

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

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(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.T.D (%)	Depo	Stok
A.HİSSE SENEDİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B.BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvili	T.C.	17.02.2021	TRT170221T12	0,05	6	1.350.000	93,87	10.12.2020	69,06	-	103,46	1	1.396.748	11,55	10,75	10,76	SRB	48 FNY
	T.C.	21.04.2021	TRT210421T14	0,10	6	1.500.000	117,32	15.01.2020	55,89	-	105,76	1	1.586.381	13,12	12,21	12,22	SRB	111 FNY
	T.C.	22.09.2021	TRT220921T18	0,05	6	1.400.000	99,55	1.12.2020	15,90	-	98,14	1	1.374.001	11,36	10,57	10,58	SRB	83 FNY
	T.C.	2.03.2022	TRT020322T17	0,06	6	474.000	105,06	5.07.2017	9,95	-	99,39	1	471.117	3,89	3,63	3,63	SRB	426 FNY
	T.C.	20.04.2022	TRT200422T14	0,04	6	700.000	96,84	16.09.2015	7,14	-	99,76	1	698.328	5,77	5,37	5,38	SRB	111 -
	T.C.	17.08.2022	TRT170822T15	0,05	6	300.000	102,56	17.07.2020	7,47	-	98,48	1	295.428	2,44	2,27	2,28	SRB	594 FNY
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	0,06	6	500.000	109,54	29.05.2020	4,52	-	102,50	1	512.504	4,24	3,94	3,95	SRB	748 FNY
	T.C.	18.10.2023	TRT181023T19	0,10	6	500.000	128,04	29.05.2020	0,27	-	119,21	1	596.067	4,93	4,59	4,59	SRB	1.021 FNY
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	0,05	6	1.000.000	92,55	22.10.2020	4,68	-	92,61	1	926.141	7,66	7,13	7,13	SRB	27 FNY
	T.C.	12.03.2025	TRT120325T12	0,04	6	100.000	91,01	22.06.2016	5,36	-	86,76	1	86.760	0,72	0,67	0,67	SRB	76 -
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	0,05	6	900.000	96,36	16.11.2020	2,57	-	97,14	1	874.243	7,23	6,73	6,73	SRB	48 FNY
	T.C.	24.02.2027	TRT240227T17	0,06	6	1.200.000	89,62	24.04.2020	2,21	-	97,02	1	1.164.186	9,62	8,96	8,97	SRB	2.246 FNY
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	0,05	6	400.000	88,51	7.10.2020	2,29	-	95,15	1	380.586	3,15	2,93	2,93	SRB	2.414 FNY
	T.C.	8.03.2028	TRT080328T15	0,06	6	200.000	112,04	10.03.2020	1,24	-	102,90	1	205.791	1,70	1,58	1,59	SRB	2.624 FNY
	T.C.	13.11.2030	TRT131130T14	0,12	2	500.000	95,54	18.12.2020	1,48	-	96,60	1	482.986	3,99	3,72	3,72	SRB	3.604 FNY
ARA GRUP TOPLAMI						11.024.000							11.051.266		85,04	85,13		
Özel Sektör Tahvil	Yapı Kredi Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	22.01.2021	TRSTPRS12115	0,04	3	100.000	101,56	1.06.2020	3.128,37	-	102,59	1	102.587	0,85	0,79	0,79	SRB	22 FNY
ARA GRUP TOPLAMI						100.000							102.587		0,79	0,79		
Finansman Bonosu	-	10.06.2021	TRFDZBK62111	0,00	0	100.000	91,35	11.06.2020	20,02	-	92,31	1	92.313	0,76	0,71	0,71	SRB	161 AAA
	-	5.05.2021	TRFHSBC52115	0,00	0	280.000	92,06	7.10.2020	19,42	-	94,15	1	263.614	2,18	2,03	2,03	SRB	125 AAA
ARA GRUP TOPLAMI						380.000							355.927		2,74	2,74		
Banka Bonosu	-	21.01.2022	TRSDZBK12226	0,00	0	100.000	85,91	8.07.2020	10,36	-	90,12	1	90.120	0,75	0,69	0,69	SRB	386 AAA
	-	5.03.2021	TRFTEBK32115	0,02	3	500.000	100,00	5.06.2020	76,26	-	99,20	1	496.021	4,10	3,82	3,82	SRB	64 AAA
ARA GRUP TOPLAMI						600.000							586.141		4,51	4,52		
GRUP TOPLAMI						12.104.000							12.095.922		93,08	93,18		
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Repo	Günlük			Toplam	Grup	Toplam	F.T.D			Stok
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Oranı	Ödeme	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Teminat Tutar	Birim Deger	Günlük Kur		Deger	(%)	(%)	(%)	Depo	VKG	Depo
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
H.VADELİ MEVDUAT	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
L.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI																				
BPP	-	4.01.2021	-	0,18	-	747.459	100.000,00	31.12.2020	19,52	-	100.048,87	1		746.365	100,00	5,74	5,75	-		4 FNY
GRUP TOPLAMI						747.459								746.365		5,74	5,75			
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																				
VIOP Nakit	-	-	-	-	-	153.291	1,00	19.11.2020	-	-	1,00	1		153.291	100,00	1,18	1,18	-	0	-
GRUP TOPLAMI						153.291								153.291		1,18	1,18			
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						13.004.751								12.995.578						0

**CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. KAMU BORÇLANMA ARAÇLARI GRUP
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Kamu Borçlanma Araçları Grup
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	12.995.578	-	100,11	13.934.264	-	100,09
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	12.995.578	-	100,11	13.934.264	-	100,09
B,HAZIR DEĞERLER	1.553	-	0,01	2.410	-	0,02
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	1.553	0,00	0,00	2.410	100,00	0,02
C,ALACAKLAR	0	-	0,00	0	0,00	0,00
a) Takastan Alacaklar T1	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	0	0,00	0,00	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0	0,00	0,00	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	0	0,00	0,00	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	15.469	-	0,00	15.353	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	11.007	71,15	0,00	11.832	77,06	-
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	4.462	28,85	0,00	3.521	22,94	-
i) Denetim Ücreti	3.916	25,31	0,00	2.015	13,12	-
ii) İlan Giderleri	0	0,00	0,00	-	-	-
iii) Noter Masrafı	0	0,00	0,00	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	389	2,52	0,00	418	2,72	-
v) Takas Saklama Komisyonu	0	0,00	0,00	-	-	-
vi) Diğer	157	1,02	0,00	1.089	7,09	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	12.981.661			13.921.321		