

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.
Dengeli Değişken 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. DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK
YATIRIM FONU**
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım
Fonu”)

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-4
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	5

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Dengeli Değişken 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	AEFES	-	AEFES	-	-	43.000	20,77	16.09.2020	-	-	-	23,18	1	996.740	2,41	0,77	0,77	SRB	0	-
	AKBNK	-	AKBNK	-	-	140.000	5,97	16.11.2020	-	-	-	6,93	1	970.200	2,35	0,75	0,75	SRB	0	-
	AKGRT	-	AKGRT	-	-	117.500	5,88	27.05.2020	-	-	-	9,30	1	1.092.750	2,64	0,85	0,85	SRB	0	-
	AKSEN	-	AKSEN	-	-	29.453	6,82	5.11.2020	-	-	-	7,44	1	219.130	0,53	0,17	0,17	SRB	0	-
	ALARK	-	ALARK	-	-	115.000	8,44	30.12.2020	-	-	-	8,64	1	993.600	2,40	0,77	0,77	SRB	0	-
	ALKIM	-	ALKIM	-	-	0,25	5,36	24.10.2019	-	-	-	14,90	1	3,73	0,00	0,00	0,00	SRB	0	-
	ARCLK	-	ARCLK	-	-	35.000	17,10	10.06.2020	-	-	-	30,40	1	1.064.000	2,57	0,82	0,82	SRB	0	-
	ASELS	-	ASELS	-	-	100.000	11,76	12.02.2020	-	-	-	18,25	1	1.825.000	4,41	1,41	1,41	SRB	0	-
	BIMAS	-	BIMAS	-	-	15.500	61,27	8.09.2020	-	-	-	75,50	1	1.170.250	2,83	0,91	0,90	SRB	0	-
	CCOLA	-	CCOLA	-	-	11.500	51,60	6.11.2020	-	-	-	65,80	1	756.700	1,83	0,59	0,59	SRB	0	-
	EREGL	-	EREGL	-	-	180.000	8,48	11.11.2020	-	-	-	14,93	1	2.687.400	6,50	2,08	2,08	SRB	0	-
	FROTO	-	FROTO	-	-	7.000	122,41	8.12.2020	-	-	-	126,00	1	882.000	2,13	0,68	0,68	SRB	0	-
	GARAN	-	GARAN	-	-	275.000	8,12	23.11.2020	-	-	-	10,37	1	2.851.750	6,90	2,21	2,21	SRB	0	-
	GMSTR	-	GMSTR	-	-	1.500	43,14	8.09.2020	-	-	-	42,28	1	63.420	0,15	0,05	0,05	SRB	0	-
	ISCTR	-	ISCTR	-	-	390.000	5,60	10.11.2020	-	-	-	7,00	1	2.730.000	6,60	2,11	2,11	SRB	0	-
	ISMEN	-	ISMEN	-	-	90.000	9,98	6.11.2020	-	-	-	17,66	1	1.589.400	3,84	1,23	1,23	SRB	0	-
	KCHOL	-	KCHOL	-	-	95.000	15,58	9.11.2020	-	-	-	21,12	1	2.006.400	4,85	1,55	1,55	SRB	0	-
	KOZAL	-	KOZAL	-	-	21.000	64,26	27.05.2020	-	-	-	96,70	1	2.030.700	4,91	1,57	1,57	SRB	0	-
	KRDMD	-	KRDMD	-	-	215.000	4,86	20.11.2020	-	-	-	5,78	1	1.242.700	3,01	0,96	0,96	SRB	0	-
	MGROS	-	MGROS	-	-	50.000	31,17	27.05.2020	-	-	-	42,80	1	2.140.000	5,18	1,66	1,65	SRB	0	-
	SAHOL	-	SAHOL	-	-	70.000	8,58	1.06.2020	-	-	-	11,46	1	802.200	1,94	0,62	0,62	SRB	0	-
	TATGD	-	TATGD	-	-	70.000	7,58	13.05.2020	-	-	-	11,86	1	830.200	2,01	0,64	0,64	SRB	0	-
	TCELL	-	TCELL	-	-	102.500	14,12	22.06.2020	-	-	-	16,10	1	1.650.250	3,99	1,28	1,28	SRB	0	-
	TOASO	-	TOASO	-	-	5.000	24,50	27.05.2020	-	-	-	33,92	1	169.600	0,41	0,13	0,13	SRB	0	-
	TTKOM	-	TTKOM	-	-	240.000	7,84	20.05.2020	-	-	-	8,54	1	2.049.600	4,96	1,59	1,58	SRB	0	-

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Dengeli Değişken 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	Deger/ Kontrat Sayısı	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Günlük	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup	Toplam	F.T.D	Stok		
				Faiz Oranı	Ödeme Sayısı		Alış Fiyatı	Alış Tarihi	Oranı	Sözleşme No	Teminat Tutar	Birim Deger			Gün Kur	(%)	(%)		(%)	Depo
	TTRAK	-	TTRAK	-	-	2.500	101,70	7.10.2020	-	-	-	182,70	1	456.750	1,10	0,35	0,35	SRB	0	-
	TUPRS	-	TUPRS	-	-	18.250	99,78	9.11.2020	-	-	-	108,00	1	1.971.000	4,77	1,53	1,52	SRB	0	-
	ULKER	-	ULKER	-	-	44.817	19,10	8.10.2019	-	-	-	23,14	1	1.037.065	2,51	0,80	0,80	SRB	0	-
	VAKBN	-	VAKBN	-	-	250.000	4,56	13.11.2020	-	-	-	4,71	1	1.177.500	2,85	0,91	0,91	SRB	0	-
	YATAS	-	YATAS	-	-	106.802	8,02	23.06.2020	-	-	-	14,45	1	1.543.289	3,73	1,19	1,19	SRB	0	-
	YKBNK	-	YKBNK	-	-	760.000	2,68	20.11.2020	-	-	-	3,08	1	2.340.800	5,66	1,81	1,81	SRB	0	-
GRUP TOPLAMI						3.601.322						41.340.398		31,99		31,97				
B.BORÇLANMA SENETLERİ																				
Devlet Tahvili	T.C.	17.02.2021	TRT170221T12	0,05	6	146.000	99,32	17.01.2019	69,06	-	-	103,46	1	151.056	0,25	0,12	0,12	SRB	48	FNY
	T.C.	22.09.2021	TRT220921T18	0,05	6	1.144.000	95,95	17.01.2019	15,90	-	-	98,14	1	1.122.755	1,84	0,87	0,87	SRB	83	FNY
	T.C.	12.01.2022	TRT120122T17	0,05	6	9.097.000	95,63	15.01.2020	10,21	-	-	99,06	1	9.011.865	14,80	6,97	6,97	SRB	13	FNY
	T.C.	2.03.2022	TRT020322T17	0,06	6	9.157.000	102,10	7.10.2020	9,95	-	-	99,39	1	9.101.296	14,95	7,04	7,04	SRB	426	FNY
	T.C.	20.04.2022	TRT200422T14	0,04	6	6.000.000	96,85	16.09.2015	7,14	-	-	99,76	1	5.985.668	9,83	4,63	4,63	SRB	111	-
	T.C.	17.08.2022	TRT170822T15	0,05	6	3.143.000	98,63	17.01.2019	7,47	-	-	98,48	1	3.095.103	5,08	2,40	2,39	SRB	594	FNY
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	0,06	6	2.135.000	100,88	7.10.2020	4,52	-	-	102,50	1	2.188.393	3,60	1,69	1,69	SRB	748	FNY
	T.C.	8.03.2023	TRT080323T10	0,04	6	158.000	74,13	17.01.2019	8,40	-	-	89,82	1	141.916	0,23	0,11	0,11	SRB	69	FNY
	T.C.	14.06.2023	TRT140623T19	0,08	6	99.000	100,14	17.01.2019	4,10	-	-	105,31	1	104.254	0,17	0,08	0,08	SRB	895	FNY
	T.C.	27.09.2023	TRT270923T11	0,04	6	121.000	77,76	17.01.2019	6,64	-	-	91,26	1	110.421	0,18	0,09	0,09	SRB	90	FNY
	T.C.	18.10.2023	TRT181023T19	0,10	6	24.000	116,69	17.01.2019	0,27	-	-	119,21	1	28.611	0,05	0,02	0,02	SRB	1021	FNY
	T.C.	20.03.2024	TRT200324T13	0,05	6	2.071.000	89,29	26.09.2019	4,74	-	-	95,11	1	1.969.789	3,24	1,52	1,52	SRB	83	FNY
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	0,05	6	618.000	85,28	17.01.2019	4,68	-	-	92,61	1	572.355	0,94	0,44	0,44	SRB	27	FNY
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	0,05	6	3.000.000	95,57	12.03.2020	2,57	-	-	97,14	1	2.914.145	4,79	2,26	2,25	SRB	48	FNY
	T.C.	24.02.2027	TRT240227T17	0,06	6	150.000	82,25	17.01.2019	2,21	-	-	97,02	1	145.523	0,24	0,11	0,11	SRB	2.246	FNY
	T.C.	8.03.2028	TRT080328T15	0,06	6	1.598.000	91,94	5.11.2019	1,24	-	-	102,90	1	1.644.269	2,70	1,27	1,27	SRB	2.624	FNY
ARA GRUP TOPLAMI						38.661.000						38.287.418		29,63		29,61				
Özel Sektör Tahvil	ARÇELİK	12.02.2021	TRSARCL22117	0,04	3	855.000	100,00	15.02.2019	449,98	-	-	102,48	1	876.216	1,44	0,68	0,68	SRB	43	AAA
	Arçelik	16.07.2021	TRSARCL72112	0,04	3	800.000	100,00	24.07.2019	37,21	-	-	102,91	1	823.290	1,35	0,64	0,64	SRB	197	AAA
	BOLU ÇİMENTO A.Ş.	5.07.2021	TRSBOLU72119	0,03	3	1.500.000	100,00	8.07.2019	43,43	-	-	103,36	1	1.550.444	2,55	1,20	1,20	SRB	186	AAA
	Ereğli Demir ve Çelik Fabrikaları T.A.Ş	28.05.2021	TRSERGL52117	0,03	3	1.500.000	100,00	31.05.2019	73,65	-	-	101,60	1	1.524.063	2,50	1,18	1,18	SRB	148	AAA
	KOÇ FİAT KF	10.06.2021	TRSKFTF62113	0,03	3	1.300.000	100,00	13.06.2019	69,91	-	-	101,02	1	1.313.287	2,16	1,02	1,02	SRB	161	AAA
	Yapı Kredi Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	22.01.2021	TRSTPRS12115	0,04	3	1.000.000	100,00	25.01.2019	3.128,37	-	-	102,59	1	1.025.871	1,69	0,79	0,79	SRB	22	AAA
	TÜPRAŞ	5.02.2021	TRSTPRS22114	0,04	3	1.000.000	100,00	8.02.2019	670,21	-	-	102,53	1	1.025.306	1,68	0,79	0,79	SRB	36	AAA
ARA GRUP TOPLAMI						7.955.000						8.138.478		6,30		6,29				

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Günlük									
Kıymet	Kurum	Tarihi	Menkul Tanımı	Faiz Oranı	Ödeme Sayısı	Deger/ Kontrat Sayısı	Alış Fiyatı	Alış Tarihi	İskonto Oranı	Sözleşme No	Teminat Tutar	Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D (%)	Depo	VKG	Stok Depo
Finansman Bonosu	-	10.06.2021	TRFDZBK62111	0,00	0	2.300.000	92,15	30.11.2020	20,02	-	-	92,31	1	2.123.202	3,49	1,64	1,64	SRB	161	FNy
	-	5.05.2021	TRFHsBC52115	0,00	0	1.120.000	92,06	7.10.2020	19,42	-	-	94,15	1	1.054.455	1,73	0,82	0,82	SRB	125	AAA
ARA GRUP TOPLAMI						3.420.000								3.177.657		2,46	2,46			
Banka Bonosu	-	5.03.2021	TRFTEBK32115	0,02	3	4.000.000	100,00	5.06.2020	76,26	-	-	99,20	1	3.968.166	6,52	3,07	3,07	SRB	64	AAA
	-	22.04.2021	TRFTEBK42114	0,01	12	3.500.000	97,75	25.11.2020	39,99	-	-	99,60	1	3.486.113	5,73	2,70	2,70	SRB	112	FNy
ARA GRUP TOPLAMI						7.500.000								7.454.279		5,77	5,76			
Euro Tahvil (Türk)	QNBFB 4.875% 05/22 USD	19.05.2022	XS1613091500	0,02	6	500.000	96,46	4.05.2020	-	-	-	102,80	7,4194	3.813.683	6,27	2,95	2,95	SRB	504	-
ARA GRUP TOPLAMI						500.000								3.813.683		2,95	2,95			
GRUP TOPLAMI						58.036.000								60.871.515		47,11	47,07			
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO																				
Devlet Tahvili Repo	T.C.	4.01.2021	TRT280628T18	0,18	-	12.023.540	147,25	31.12.2020	19,58	A3B6902000FCCCC	8.149.180	147,33	1	12.005.881	100,00	9,29	9,28	SRB	4	FNy
GRUP TOPLAMI						12.023.540								12.005.881		9,29	9,28			
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
H.VADELİ MEVDUAT																				
Vadeli Mevduat (TL)	ANADOLU BANK A.	1.02.2021	-	0,18	-	6.480.259	100,00	28.12.2020	0,00	-	-	100,20	1	6.493.085	100,00	5,02	5,02	SRB	32	AAA
GRUP TOPLAMI						6.480.259								6.493.085		5,02	5,02			
L.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI																				
BPP	-	4.01.2021	-	0,18	-	2.903.669	100.000,00	31.12.2020	19,52	-	-	100.048,87	1	2.899.416	52,04	2,24	2,24	-	4	FNy
	-	4.01.2021	-	0,18	-	2.676.225	100.000,00	31.12.2020	19,52	-	-	100.048,87	1	2.672.305	47,96	2,07	2,07	-	4	FNy
GRUP TOPLAMI						5.579.894								5.571.721		4,31	4,31			

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Dengeli Değişken Emeklilik Yatırım Fonu”)

31 ARALIK 2020 TARİHLİ FİYAT RAPORU

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

Menkul	İhraççı	Vade	Nom.	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Günlük										
Kıymet	Kurum	Tarihi	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Sözleşme	Teminat	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam	F.T.D				
			Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	No	Tutar	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)	(%)	Depo	VKG	Depo	
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																					
VIOP Nakit	-	-	-	-	-	2.934.539	1,00	15.03.2013	-	-	-	1,00	1	2.934.539	100,00	2,27	2,27	-	0	-	-
GRUP TOPLAMI						2.934.539								2.934.539		2,27	2,27				
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						88.655.554								129.217.140						0	
VIOP Sözleşmesi	Uzun	26.02.2021	F_XU0300221	-	-	400	1.648,94	29.12.2020	-	-	-	1.658,50	1	6.634.000	100,00	5,13	5,13	-	57	-	-
GRUP TOPLAMI						400								6.634.000		5,13	5,13				

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Dengeli Değişken 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	129.217.140	-	99,92	123.871.756	-	100,20
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	129.217.140	-	99,92	123.871.757	-	100,20
B,HAZIR DEĞERLER	3.642	-	0,00	1.610	-	-
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	3.642	100,00	0,00	1.610	100,00	-
C,ALACAKLAR	711.774	-	0,55	0	0,00	0,00
a) Takastan Alacaklar T1	0	0,00	0,00	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	711.504	99,96	1,10	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0	0,00	0,00	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	270	0,04	0,00	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	615.456	-	0,00	249.877	0,00	0,00
a) Takasa Borçlar T1	294.600	47,87	0,00	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00	0,00	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	188.000	30,55	0,00	181.693	72,71	-
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	132.856	21,59	0,00	68.184	27,29	-
i) Denetim Ücreti	32.186	5,23	0,00	17.286	6,92	-
ii) İlan Giderleri	0	0,00	0,00	-	-	-
iii) Noter Masrafı	0	0,00	0,00	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	3.880	0,63	0,00	3.709	1,48	-
v) Takas Saklama Komisyonu	0	0,00	0,00	-	-	-
vi) Diğer	96.790	15,73	0,00	47.189	18,88	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	129.317.099			123.623.489		