

CİGNA SAĞLIK HAYAT A.Ş.
BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.
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. BORÇLANMA ARAÇLARI
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Borçlanma Araçları 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. BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. 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								
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Faiz Oranı	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	
A.HİSSE SENEDİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
B.BORÇLANMA SENETLERİ																					
Devlet Tahvili	T.C.	14.04.2021	TRT140421T13	0,00	0	170.000	92,29	8.10.2020	15,60	-	-	95,99	1	163.187	19,49	18,64	18,63	SRB	104	FNY	
	T.C.	21.04.2021	TRT210421T14	0,10	6	130.000	113,52	16.09.2020	55,89	-	-	105,76	1	137.486	16,42	15,70	15,69	SRB	111	FNY	
	T.C.	9.06.2021	TRT090621T18	0,00	0	2.000	92,92	8.10.2020	16,07	-	-	93,71	1	1.874	0,22	0,21	0,21	SRB	160	FNY	
	T.C.	18.08.2021	TRT180821T15	0,00	0	12.000	91,00	8.10.2020	15,24	-	-	91,49	1	10.978	1,31	1,25	1,25	SRB	230	FNY	
	T.C.	12.01.2022	TRT120122T17	0,05	6	100.000	104,22	8.07.2020	10,21	-	-	99,06	1	99.064	11,83	11,31	11,31	SRB	13	FNY	
	T.C.	2.03.2022	TRT020322T17	0,06	6	70.000	98,93	3.04.2020	9,95	-	-	99,39	1	69.574	8,31	7,95	7,94	SRB	426	FNY	
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	0,06	6	50.000	104,71	28.11.2019	4,52	-	-	102,50	1	51.250	6,12	5,85	5,85	SRB	748	FNY	
	T.C.	8.03.2023	TRT080323T10	0,04	6	50.000	82,64	26.09.2019	8,40	-	-	89,82	1	44.910	5,36	5,13	5,13	SRB	69	FNY	
	T.C.	20.03.2024	TRT200324T13	0,05	6	100.000	87,60	25.09.2019	4,74	-	-	95,11	1	95.113	11,36	10,86	10,86	SRB	83	FNY	
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	0,05	6	40.000	92,50	24.04.2020	4,68	-	-	92,61	1	37.046	4,42	4,23	4,23	SRB	27	FNY	
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	0,05	6	50.000	92,20	25.09.2020	2,57	-	-	97,14	1	48.569	5,80	5,55	5,54	SRB	48	FNY	
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	0,05	6	50.000	93,54	31.03.2020	2,29	-	-	95,15	1	47.573	5,68	5,43	5,43	SRB	2.414	FNY	
	T.C.	8.03.2028	TRT080328T15	0,06	6	30.000	111,36	24.04.2020	1,24	-	-	102,90	1	30.869	3,69	3,53	3,52	SRB	2.624	FNY	
GRUP TOPLAMI						854.000								837.494		95,66	95,60				
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
F.TERS REPO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
H.VADELİ MEVDUAT	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
I.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
K.BORSA PARA PİYASASI																					
BPP	-	4.01.2021	-	0,18	-	38.074	100.000,00	31.12.2020	19,40	-	-	100.048,61	1	38.018	100,00	4,34	4,34	-	4	FNY	
GRUP TOPLAMI						38.074								38.018		4,34	4,34				

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						892.074								875.512						0

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

(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. 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	875.512	-	99,94	1.060.668	-	100,06
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	875.512	-	99,94	1.060.668	-	100,06
B,HAZIR DEĞERLER	1.882	-	0,21	1.833	-	0,17
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	1.882	100,00	0,21	1.833	100,00	0,17
C,ALACAKLAR	10.562	-	1,21	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	10.562	100,00	2,41	-	-	-
D,DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	11.960	-	0,00	2.452	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	1.372	11,47	0,00	1.656	67,55	-
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	10.589	88,53	0,00	796	32,45	-
i) Denetim Ücreti	0	0,00	0,00	-	-	-
ii) İlan Giderleri	0	0,00	0,00	-	-	-
iii) Noter Masrafı	0	0,00	0,00	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	26	0,22	0,00	32	1,30	-
v) Takas Saklama Komisyonu	0	0,00	0,00	-	-	-
vi) Diğer	10.562	88,31	0,00	764	31,16	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	875.996			1.060.049		