

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.
Oks Muhafazakar 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. OKS MUHAFAZAKAR
DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU**
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks Muhafazakar Değişken
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. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks Muhafazakar 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 Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük 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	30.000	95,05	9.12.2020	15,60	-	-	95,99	1	28.798	4,90	3,34	3,38	SRB	104 FNY
ARA GRUP TOPLAMI						30.000								28.798		3,34	3,38		
Özel Sektör Tahvil	AKFEN HOLDİNG	4.02.2022	TRSAKFH22212	0,03	3	20.000	100,00	7.02.2020	10,70	-	-	101,09	1	20.217	3,44	2,34	2,38	SRB	400 AAA
	Yapi Kredi Yatırım	4.08.2021	TRSAYGZ82118	0,04	3	16.000	100,00	7.08.2019	29,26	-	-	102,64	1	16.422	2,80	1,90	1,93	SRB	216 AAA
	-	8.01.2021	TRSFNBK12110	0,00	3	5.000	100,00	3.01.2020	0,00	-	-	103,81	1	5.190	0,88	0,60	0,61	SRB	8 FNY
	-	16.12.2021	TRSKFTFA2114	0,05	6	20.000	100,00	18.06.2020	17,53	-	-	94,02	1	18.803	3,20	2,18	2,21	SRB	350 AAA
	-	18.06.2021	TRSYKKBK62112	0,02	3	35.000	100,00	17.06.2020	20,15	-	-	100,37	1	35.131	5,98	4,07	4,13	SRB	169 AAA
ARA GRUP TOPLAMI						96.000								95.765		11,10	11,25		
Finansman Bonosu	Alternatif Bank A.Ş.	4.03.2021	TRFALNF32123	0,00	0	35.000	95,91	1.12.2020	17,83	-	-	97,25	1	34.038	5,80	3,94	4,00	SRB	63 AAA
	-	5.01.2021	TRFFFKR12119	0,00	0	70.000	96,19	15.09.2020	13,49	-	-	99,86	1	69.903	11,91	8,10	8,21	SRB	5 AAA
	-	5.01.2021	TRFGRFA12126	0,00	0	35.000	96,55	1.10.2020	14,29	-	-	99,85	1	34.949	5,95	4,05	4,11	SRB	5 AAA
	-	21.01.2021	TRFGRFK12117	0,00	0	35.000	95,93	23.09.2020	13,47	-	-	99,31	1	34.759	5,92	4,03	4,08	SRB	21 AAA
	-	5.05.2021	TRFHSBC52115	0,00	0	20.000	92,06	7.10.2020	19,42	-	-	94,15	1	18.830	3,21	2,18	2,21	SRB	125 AAA
	-	8.01.2021	TRFISFA12112	0,00	0	35.000	96,40	29.09.2020	14,17	-	-	99,75	1	34.911	5,95	4,04	4,10	SRB	8 AAA
	İş Finansal Kiralama A.Ş.	9.03.2021	TRFISFN32113	0,00	0	60.000	95,94	9.12.2020	18,29	-	-	96,96	1	58.178	9,91	6,74	6,84	SRB	68 AAA
	Yapi Kredi Faktoring A.Ş.	23.02.2021	TRFYAKF22115	0,00	0	35.000	96,95	22.12.2020	19,63	-	-	97,43	1	34.101	5,81	3,95	4,01	SRB	54 AAA
	Yapi Kredi Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	10.03.2021	TRFYKYM32110	0,00	0	70.000	95,87	9.12.2020	18,46	-	-	96,89	1	67.826	11,55	7,86	7,97	SRB	69 AAA
	-	5.01.2021	TRFAKBK12122	0,00	0	40.000	99,76	31.12.2020	19,61	A3B6902000F7369	-	99,80	1	39.922	6,80	4,63	4,69	SRB	5 FNY
	-	12.03.2021	TRFDZBK32114	0,02	3	35.000	100,00	17.06.2020	55,14	-	-	100,40	1	35.141	5,99	4,07	4,13	SRB	71 AAA
ARA GRUP TOPLAMI						470.000								462.556		53,59	54,35		
GRUP TOPLAMI						596.000								587.119		68,03	68,98		
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
D. OPSİYON İŞLEMLER	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks Muhafazakar 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 Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D (%)	Depo VKG	Stok Depo
H.VADELİ MEVDUAT																			
Vadeli Mevduat (TL)	TEB A.Ş.	5.01.2021	-	0,17	-	30.000	100,00	4.12.2020	0,00	-	-	101,30	1	30.390	15,43	3,52	3,57	SRB	5 AAA
	AKBANK T.A.Ş.	5.01.2021	-	0,17	-	30.000	100,00	4.12.2020	0,00	-	-	101,30	1	30.390	15,43	3,52	3,57	SRB	5 AAA
	T.GARANTİ BANKA	22.01.2021	-	0,17	-	31.337	100,00	21.12.2020	0,00	-	-	100,49	1	31.492	15,99	3,65	3,70	SRB	22 AAA
	FİBABANKA A.Ş.	26.01.2021	-	0,18	-	32.511	100,00	25.12.2020	0,00	-	-	100,34	1	32.622	16,57	3,78	3,83	SRB	26 AAA
	VAKIFBANK ETİLE	26.01.2021	-	0,18	-	31.416	100,00	25.12.2020	0,00	-	-	100,34	1	31.523	16,01	3,65	3,70	SRB	26 AAA
	ANADOLU BANK A.	1.02.2021	-	0,18	-	40.432	100,00	28.12.2020	0,00	-	-	100,20	1	40.512	20,57	4,69	4,76	SRB	32 AAA
GRUP TOPLAMI						195.696								196.928		22,82	23,14		
L.KIYMETLİ MADEN																			
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI																			
BPP	-	4.01.2021	-	0,18	-	79.154	100.000,00	31.12.2020	19,40	-	-	100.048,59	1	79.038	100,00	9,16	9,29	-	4 FNY
GRUP TOPLAMI						79.154								79.038		9,16	9,29		
L.VARANT İŞLEMLERİ																			
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						870.850								863.085				0	

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks Muhafazakar 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	863.085	-	101,41	817.088	-	100,77
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	863.086	-	101,41	817.088	-	100,77
B,HAZIR DEĞERLER	1.763	-	0,21	1.768	-	0,22
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	1.763	100,00	0,21	1.768	100,00	0,22
C,ALACAKLAR	3.051	-	0,36	4.436	0,00	0,55
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	3.051	100,00	0,72	4.436	100,00	1,09
D,DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	16.808	-	0,00	12.480	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	612	3,64	0,00	582	4,67	-
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	16.196	96,36	0,00	11.898	95,33	-
i) Denetim Ücreti	5.526	32,88	0,00	5.311	42,56	-
ii) İlan Giderleri	0	0,00	0,00	-	-	-
iii) Noter Masrafı	0	0,00	0,00	-	-	-
iv) İhraç İzin Gideri	0	0,00	0,00	-	-	-
v) Takas Saklama Komisyonu	0	0,00	0,00	-	-	-
vi) Diğer	10.670	63,48	0,00	6.586	52,78	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	851.092			810.811		