

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş.
Oks 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. OKS DENGELİ DEĞİŞKEN
EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks Dengeli 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 DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks 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	ALKIM	-	ALKIM	-	-	1	13,86	28.09.2020	-	-	-	14,90	1	10	0,00	0,00	0,00	SRB	0	-						
	EREGL	-	EREGL	-	-	3.490	10,11	22.12.2020	-	-	-	14,93	1	52.106	13,37	5,23	5,23	SRB	0	-						
	FONET	-	FONET	-	-	1.200	11,39	18.12.2020	-	-	-	13,03	1	15.636	4,01	1,57	1,57	SRB	0	-						
	GARAN	-	GARAN	-	-	4.500	7,96	11.11.2020	-	-	-	10,37	1	46.665	11,98	4,68	4,68	SRB	0	-						
	ISCTR	-	ISCTR	-	-	3.750	6,72	17.12.2020	-	-	-	7,00	1	26.250	6,74	2,63	2,63	SRB	0	-						
	ISMEN	-	ISMEN	-	-	1.750	11,75	12.11.2020	-	-	-	17,66	1	30.905	7,93	3,10	3,10	SRB	0	-						
	KRDMD	-	KRDMD	-	-	7.500	5,15	21.12.2020	-	-	-	5,78	1	43.350	11,13	4,35	4,35	SRB	0	-						
	SISE	-	SISE	-	-	2.250	6,40	30.09.2020	-	-	-	7,31	1	16.448	4,22	1,65	1,65	SRB	0	-						
	TOASO	-	TOASO	-	-	750	21,91	30.09.2020	-	-	-	33,92	1	25.440	6,53	2,55	2,55	SRB	0	-						
	TUPRS	-	TUPRS	-	-	300	89,34	23.12.2020	-	-	-	108,00	1	32.400	8,32	3,25	3,25	SRB	0	-						
	TURSG	-	TURSG	-	-	1.750	6,54	29.12.2020	-	-	-	6,60	1	11.550	2,96	1,16	1,16	SRB	0	-						
	VESBE	-	VESBE	-	-	750	28,64	12.10.2020	-	-	-	40,88	1	30.660	7,87	3,08	3,08	SRB	0	-						
	YATAS	-	YATAS	-	-	2.750	8,03	16.09.2020	-	-	-	14,45	1	39.738	10,20	3,99	3,99	SRB	0	-						
	YKBNK	-	YKBNK	-	-	6.000	2,58	17.11.2020	-	-	-	3,08	1	18.480	4,74	1,85	1,85	SRB	0	-						
GRUP TOPLAMI						36,741															389,637		39,08		39,11	
B.BORÇLANMA SENETLERİ																										
Devlet Tahvili	T.C.	14.04.2021	TRT140421T13	0,00	0	140.000	94,34	27.10.2020	15,60	-	-	95,99	1	134.389	34,38	13,48	13,49	SRB	104	FNY						
	T.C.	21.04.2021	TRT210421T14	0,10	6	50.000	112,47	15.05.2020	55,89	-	-	105,76	1	52.879	13,53	5,30	5,31	SRB	111	FNY						
ARA GRUP TOPLAMI						190,000															187,268		18,78		18,80	
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	5,17	2,03	2,03	SRB	400	AAA						
	Yapi Kredi Yatırım	4.08.2021	TR SAYGZ82118	0,04	3	15.000	100,00	7.08.2019	29,26	-	-	102,64	1	15.396	3,94	1,54	1,55	SRB	216	AAA						
	İŞ GYO	25.01.2021	TR SİSGY12113	0,04	3	10.000	100,00	28.01.2019	2.191,58	-	-	102,96	1	10.296	2,63	1,03	1,03	SRB	25	AAA						
ARA GRUP TOPLAMI						45,000															45,910		4,60		4,61	
Finansman Bonosu	Alternatif Bank A.Ş.	4.03.2021	TRFALNF32123	0,00	0	30.000	95,91	1.12.2020	17,83	-	-	97,25	1	29.176	7,46	2,93	2,93	SRB	63	AAA						
	-	15.01.2021	TRFDNFK12121	0,00	0	40.000	96,93	30.10.2020	15,94	-	-	99,43	1	39.774	10,18	3,99	3,99	SRB	15	AAA						
	-	21.04.2021	TRFKCTF42119	0,00	0	40.000	92,76	25.06.2020	9,58	-	-	97,28	1	38.912	9,96	3,90	3,91	SRB	111	AAA						
ARA GRUP TOPLAMI						110,000															107,862		10,82		10,83	
Banka Bonosu	-	22.04.2021	TRFTEBK42114	0,01	12	50.000	100,00	26.06.2020	39,99	-	-	99,60	1	49.802	12,74	5,00	5,00	SRB	112	AAA						
ARA GRUP TOPLAMI						50,000															49,802		5,00		5,00	
GRUP TOPLAMI						395,000															390,841		39,20		39,23	

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks 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 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
C. KATILMA BELGESİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
D. OPSİYON İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
E.YABANCI HİSSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F.TERS REPO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
G.KATILIM HESABI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
H.VADELİ MEVDUAT																			
Vadeli Mevduat (TL)	FİBABANKA A.Ş.	26.01.2021	-	0,18	-	45.000	100,00	25.12.2020	0,00	-	-	100,34	1	45.154	36,00	4,53	4,53	SRB	26 AAA
	ANADOLU BANK A.	26.01.2021	-	0,18	-	45.000	100,00	25.12.2020	0,00	-	-	100,34	1	45.153	36,00	4,53	4,53	SRB	26 AAA
	AKBANK T.A.Ş.	26.01.2021	-	0,18	-	35.000	100,00	25.12.2020	0,00	-	-	100,35	1	35.121	28,00	3,52	3,53	SRB	26 AAA
GRUP TOPLAMI						125.000								125.429		12,58	12,59		
I.KIYMETLİ MADEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J.YABANCI TAHVİL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
K.BORSA PARA PİYASASI																			
BPP	-	4.01.2021		0,18	-	64.124	100.000,00	31.12.2020	19,40	-	-	100.048,59	1	64.031	100,00	6,42	6,43	-	4 FNY
GRUP TOPLAMI						64.124								64.031		6,42	6,43		
L.VARANT İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																			
VIOP Nakit	-	-	-	-	-	27.071	1,00	27.01.2020	-	-	-	1,00	1	27.071	100,00	2,72	2,72	-	0 -
GRUP TOPLAMI						27.071								27.071		2,72	2,72		
N.SWAP İŞLEMLERİ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
O.EUROBOND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FON PORTFÖY DEĞERİ						647.936								997.009					0

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. OKS DENGELİ DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(eski adıyla “Cigna Finans Emeklilik ve Hayat A.Ş. Oks 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	997.009	-	100,07	796.265	-	100,70
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	997.009	-	100,07	796.266	-	100,70
B,HAZIR DEĞERLER	1.750	-	0,18	1.993	-	0,25
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	1.750	100,00	0,18	1.993	100,00	0,25
C,ALACAKLAR	14.313	-	1,44	4.827	0,00	0,61
a) Takastan Alacaklar T1	776	5,42	0,16	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	8.848	61,82	1,78	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	0	0,00	0,00	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	4.689	32,76	0,94	4.827	100,00	1,22
D,DİĞER VARLIKLAR	0	-	0,00	0	0,00	0,00
E,BORÇLAR	16.807	-	0,00	12.357	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	687	4,09	0,00	562	4,54	-
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	16.120	95,91	0,00	11.795	95,46	-
i) Denetim Ücreti	5.547	33,00	0,00	5.310	42,97	-
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	10.573	62,91	0,00	6.485	52,48	-
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0	-	0,00	0	0,00	0,00
Fon toplam değeri	996.264			790.728		