

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş. ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI EMEKLİLİK YATIRIM FONU
(20.01.2022 Tarihinden Önceki Unvanı Cigna Sağlık Hayat ve Emeklilik A.Ş. Borçlanma Araçları EYF)

Fon Portföy Değeri ve Net Varlık Değeri Tabloları

1- Fon Portföy Değeri Tablosu

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)
A.HİSSE SENEDİ								
Hisse Senedi	AKSA		AKSA	95.00	5,495.75	8.61%	0.41%	0.41%
	BIMAS		BIMAS	70.00	5,659.50	8.87%	0.43%	0.42%
	KCAER		KCAER	349.00	9,423.00	14.77%	0.71%	0.71%
	KORDS		KORDS	90.00	4,444.20	6.96%	0.33%	0.33%
	ODAS		ODAS	2,000.00	5,780.00	9.06%	0.44%	0.43%
	SISE		SISE	250.00	5,375.00	8.42%	0.40%	0.40%
	THYAO		THYAO	120.00	5,616.00	8.80%	0.42%	0.42%
	TUPRS		TUPRS	21.00	5,554.50	8.70%	0.42%	0.42%
	USDTR		USDTR	7.00	11,057.90	17.33%	0.83%	0.83%
	VESBE		VESBE	600.00	5,412.00	8.48%	0.41%	0.41%
ARA GRUP TOPLAMI				3,602.00	63,817.85		4.80%	4.79%
GRUP TOPLAMI				3,602.00	63,817.85		4.80%	4.79%
B.BORÇLANMA SENETLERİ								
Devlet Tahvili	T.C.	09.11.2022	TRT091122T10	30,000.00	30,089.15	2.87%	2.26%	2.26%
	T.C.	25.01.2023	TRT250123T11	90,000.00	79,965.43	7.63%	6.02%	6.00%
	T.C.	08.03.2023	TRT080323T10	50,000.00	46,433.34	4.43%	3.49%	3.48%
	T.C.	14.06.2023	TRT140623T19	80,000.00	76,433.11	7.29%	5.75%	5.73%
	T.C.	20.09.2023	TRT200923T18	20,000.00	19,965.75	1.91%	1.50%	1.50%
	T.C.	20.03.2024	TRT200324T13	100,000.00	86,600.12	8.26%	6.52%	6.50%
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	40,000.00	33,151.93	3.16%	2.50%	2.49%

	T.C.	18.06.2025	TRT180625T13	55,000.00	147,142.14	14.04%	11.07%	11.04%
	T.C.	01.10.2025	TRT011025T16	75,000.00	60,679.73	5.79%	4.57%	4.55%
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	50,000.00	37,748.05	3.60%	2.84%	2.83%
	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	50,000.00	38,451.61	3.67%	2.89%	2.88%
	T.C.	08.03.2028	TRT080328T15	30,000.00	24,497.31	2.34%	1.84%	1.84%
	T.C.	13.11.2030	TRT131130T14	150,000.00	108,063.57	10.31%	8.13%	8.11%
ARA GRUP TOPLAMI				820,000.00	789,221.24		59.40%	59.19%
Özel Sektör Tahvil	Tat Gıda Sanayi A.Ş.	15.05.2023	TRSTATK52314	20,000.00	20,608.96	1.97%	1.55%	1.55%
	Arçelik A.Ş.	07.02.2023	TRSARCL22323	10,000.00	10,916.91	1.04%	0.82%	0.82%
	Arçelik A.Ş.	05.04.2024	TRSARCL42412	20,000.00	21,020.14	2.01%	1.58%	1.58%
		22.06.2023	TRSAYGZ62318	20,000.00	19,839.45	1.89%	1.49%	1.49%
		13.10.2023	TRSENSAE2312	20,000.00	20,416.87	1.95%	1.54%	1.53%
		14.02.2024	TRSOPAS22418	10,000.00	10,329.43	0.99%	0.78%	0.77%
	Tat Gıda	20.06.2023	TRSTATK62313	15,000.00	15,227.37	1.45%	1.15%	1.14%
ARA GRUP TOPLAMI				115,000.00	118,359.12		8.91%	8.88%
Finansman Bonosu		16.08.2022	TRFAKFK82233	20,000.00	19,562.88	1.87%	1.47%	1.47%
	GARANTİ FAKTORİNG A.Ş.	07.10.2022	TRFGRFA92227	20,000.00	19,148.79	1.83%	1.44%	1.44%
	Hektaş Ticaret T.A.Ş.	16.08.2022	TRFHEKT82216	20,000.00	19,541.69	1.86%	1.47%	1.47%
	Otokoç Otomotiv Sanayi ve Ticaret A.Ş.	15.09.2022	TRFOTKO92210	10,000.00	9,582.43	0.91%	0.72%	0.72%
	Tam Finans Faktoring A.Ş.	03.08.2022	TRFTAMF82214	10,000.00	9,801.66	0.94%	0.74%	0.74%
	TAM FİNANS FAKTORİNG A.Ş.	16.09.2022	TRFTAMF92221	20,000.00	18,852.80	1.80%	1.42%	1.41%
	Türk Ekonomi Bankası A.Ş.	22.07.2022	TRFTEBK72228	20,000.00	19,779.99	1.89%	1.49%	1.48%
		01.07.2022	TRFMCBF72219	20,000.00	24,028.94	2.29%	1.81%	1.80%
ARA GRUP TOPLAMI				140,000.00	140,299.17		10.56%	10.52%
GRUP TOPLAMI				1,075,000.00	1,047,879.53		78.87%	78.59%
C. KATILMA BELGESİ								
Katılma Belgesi			RR9	13.00	20,045.92	48.91%	1.51%	1.50%
			RP6	963.00	20,936.01	51.09%	1.58%	1.57%
ARA GRUP TOPLAMI				976.00	40,981.93		3.08%	3.07%
GRUP TOPLAMI				976.00	40,981.93		3.08%	3.07%
D. OPSİYON İŞLEMLER								
E.YABANCI HİSSE								

F.TERS REPO								
G.KATILIM HESABI								
H.VADELİ MEVDUAT								
Vadeli Mevduat (TL)	VAKIFBANK ETİLE	01.07.2022		31,916.33	31,931.20	100.00%	2.40%	2.39%
ARA GRUP TOPLAMI				31,916.33	31,931.20		2.40%	2.39%
GRUP TOPLAMI				31,916.33	31,931.20		2.40%	2.39%
I.KIYMETLİ MADEN								
J.YABANCI TAHVİL								
K.BORSA PARA PİYASASI								
BPP		01.07.2022		93,047.90	93,047.90	100.00%	7.00%	6.98%
ARA GRUP TOPLAMI				93,047.90	93,047.90		7.00%	6.98%
GRUP TOPLAMI				93,047.90	93,047.90		7.00%	6.98%
L.VARANT İŞLEMLERİ								
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ								
VIOP Nakit				7,654.19	7,654.19	100.00%	0.58%	0.57%
ARA GRUP TOPLAMI				7,654.19	7,654.19		0.58%	0.57%
GRUP TOPLAMI				7,654.19	7,654.19		0.58%	0.57%
N.SWAP İŞLEMLERİ								
O.EUROBOND FON PORTFÖY DEĞERİ								
				1,214,796.42	1,285,312.61			
Döviz Bakiyeleri	FİNANSBANK A.Ş. VADESİZ USD		USD	2,600.00	43,319.64	100.00%	3.26%	3.25%
ARA GRUP TOPLAMI				2,600.00	43,319.64		3.26%	3.25%
GRUP TOPLAMI				2,600.00	43,319.64		3.26%	3.25%

2- Net Varlık Değeri Tablosu

	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)		TUTARI(TL)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	1,285,312.61		96.40%	FON TOPLAM DEĞERİ	1,333,265.58	
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	1,285,312.88		96.40%	Toplam Pay Sayısı	1,000,000,000,000	
B. HAZIR DEĞERLER	45,614.97		3.42%	Dolaşımdaki Pay Sayısı	95,048,035.51	
a) Kasa	0.00	0.00%	0.00%	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	0.	
b) Bankalar	43,319.64	94.97%	3.25%	Merkezdeki Pay Sayısı	999,904,951,964.49	
i) TL Hesaplar	0.00	0.00%	0.00%	Fiyat	0.014027	
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	43,319.64	94.97%	3.25%	(VOB AçıkPozisyon)	0.00	0.00%
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	0.00	0.00%	0.00%	Pay Sahibi Sayısı	177	
c) Diğer Hazır Değerler	2,295.33	5.03%	0.17%	Günlük Yönetim Ücreti	67.57	
C. ALACAKLAR	7,982.87		0.60%	Dünkü Fiyat	0.014036	-0.060982%
a) Takastan Alacaklar T1	0.00	0.00%	0.00%			
b) Takastan Alacaklar T2	0.00	0.00%	0.00%			
c) Takastan BPP Alacakları	0.00	0.00%	0.00%			
d) Diğer Alacaklar	7,982.87	100.00%	1.20%			
D. DİĞER VARLIKLAR	0.00		0.00%			
E. BORÇLAR	5,644.87		0.00%			
a) Takasa Borçlar T1	0.00	0.00%	0.00%			
b) Takasa Borçlar T2	0.00	0.00%	0.00%			
c) Yönetim Ücreti	1,964.63	34.80%	0.00%			
d) Ödenecek Vergi	0.00	0.00%	0.00%			
e) İhtiyatlar	0.00	0.00%	0.00%			
f) Krediler	0.00	0.00%	0.00%			
g) Diğer Borçlar	3,680.24	65.20%	0.00%			
i) Denetim Ücreti	386.69	6.85%	0.00%			
ii) İlan Giderleri	0.00	0.00%	0.00%			
iii) Noter Masrafı	0.00	0.00%	0.00%			
iv) İhraç İzin Gideri	40.00	0.71%	0.00%			
v) Takas Saklama Komisyonu	0.00	0.00%	0.00%			
vi) Diğer	3,253.55	57.64%	0.00%			
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0.00		0.00%			
FON TOPLAM DEĞERİ	1,333,265.58					