

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
DENGELİ DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

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	5,000.00	289,250.00	4.11%	2.58%	2.58%
	AKSEN		AKSEN	8,000.00	192,640.00	2.74%	1.72%	1.72%
	ALARK		ALARK	10,300.00	337,840.00	4.80%	3.01%	3.01%
	ALKIM		ALKIM	0.14	2.90	0.00%	0.00%	0.00%
	BIMAS		BIMAS	7,750.00	626,587.50	8.90%	5.59%	5.58%
	GMSTR		GMSTR	5,000.00	356,400.00	5.06%	3.18%	3.17%
	GWIND		GWIND	28,000.00	222,320.00	3.16%	1.98%	1.98%
	ISCTR		ISCTR	45,000.87	197,103.81	2.80%	1.76%	1.75%
	ISSEN		ISSEN	1.00	25.60	0.00%	0.00%	0.00%
	KCAER		KCAER	12,561.00	339,147.00	4.82%	3.02%	3.02%
	KORDS		KORDS	6,000.00	296,280.00	4.21%	2.64%	2.64%
	KRDMD		KRDMD	12,500.00	141,000.00	2.00%	1.26%	1.26%
	MAVI		MAVI	7,000.00	367,150.00	5.21%	3.27%	3.27%
	ODAS		ODAS	100,000.00	289,000.00	4.10%	2.58%	2.57%
	OZKGY		OZKGY	50,000.00	275,500.00	3.91%	2.46%	2.45%
	PETKM		PETKM	0.76	6.70	0.00%	0.00%	0.00%
	PGSUS		PGSUS	2,000.00	342,000.00	4.86%	3.05%	3.04%
	SISE		SISE	0.80	17.20	0.00%	0.00%	0.00%
	SISE		SISE	7,500.00	161,250.00	2.29%	1.44%	1.44%
	SISE		SISE	12,500.00	268,750.00	3.82%	2.40%	2.39%
			SISE	20,000.80	430,017.20	6.11%	3.84%	3.83%
	TAVHL		TAVHL	6,000.00	298,560.00	4.24%	2.66%	2.66%
	THYAO		THYAO	15,000.00	702,000.00	9.97%	6.26%	6.25%
	TOASO		TOASO	4,500.00	270,000.00	3.84%	2.41%	2.40%
	TUPRS		TUPRS	1,050.00	277,725.00	3.94%	2.48%	2.47%
	USDTR		USDTR	500.00	789,850.00	11.22%	7.04%	7.03%
ARA GRUP TOPLAMI				346,164.57	7,040,405.72		62.80%	62.68%
GRUP TOPLAMI				346,164.57	7,040,405.72		62.80%	62.68%
B.BORÇLANMA SENETLERİ								
Devlet Tahvili	T.C.	20.03.2024	TRT200324T13	500,000.00	433,000.60	30.84%	3.86%	3.85%

ARA GRUP TOPLAMI				500,000.00	433,000.60		3.86%	3.85%
Özel Sektör Tahvil	ARÇELİK	10.02.2023	TRSARCL22315	200,000.00	210,442.65	14.99%	1.88%	1.87%
		13.10.2023	TRSENSAE2312	200,000.00	204,168.66	14.54%	1.82%	1.82%
	TÜPRAŞ	03.02.2023	TRSTPRS22312	100,000.00	102,542.64	7.30%	0.91%	0.91%
ARA GRUP TOPLAMI				500,000.00	517,153.95		4.61%	4.60%
Finansman Bonosu	Tam Finans Faktoring A.Ş.	01.09.2022	TRFTAMF92213	100,000.00	95,810.78	6.82%	0.85%	0.85%
		11.08.2022	TRFKCTF82214	100,000.00	117,574.03	8.38%	1.05%	1.05%
		01.07.2022	TRFMCBF72219	200,000.00	240,289.40	17.12%	2.14%	2.14%
ARA GRUP TOPLAMI				400,000.00	453,674.21		4.05%	4.04%
GRUP TOPLAMI				1,400,000.00	1,403,828.76		12.52%	12.50%
C. KATILMA BELGESİ								
Katılma Belgesi			RR9	142.00	218,963.16	22.64%	1.95%	1.95%
			OVD	305,710.00	296,153.20	30.62%	2.64%	2.64%
			RP6	20,787.00	451,917.80	46.73%	4.03%	4.02%
ARA GRUP TOPLAMI				326,639.00	967,034.16		8.63%	8.61%
GRUP TOPLAMI				326,639.00	967,034.16		8.63%	8.61%
D. OPSİYON İŞLEMLER								
E.YABANCI HİSSE								
F.TERS REPO								
G.KATILIM HESABI								
H.VADELİ MEVDUAT								
Vadeli Mevduat (TL)	AKBANK T.A.Ş.	14.07.2022		521,245.34	527,820.61	100.00%	4.71%	4.70%
ARA GRUP TOPLAMI				521,245.34	527,820.61		4.71%	4.70%
GRUP TOPLAMI				521,245.34	527,820.61		4.71%	4.70%
I.KIYMETLİ MADEN								
J.YABANCI TAHVİL								
K.BORSA PARA PİYASASI								
BPP		01.07.2022		589,303.38	589,303.38	100.00%	5.26%	5.25%
ARA GRUP TOPLAMI				589,303.38	589,303.38		5.26%	5.25%
GRUP TOPLAMI				589,303.38	589,303.38		5.26%	5.25%
L.VARANT İŞLEMLERİ								
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ								

VIOP Nakit				412,464.29	412,464.29	100.00%	3.68%	3.67%
ARA GRUP TOPLAMI				412,464.29	412,464.29		3.68%	3.67%
GRUP TOPLAMI				412,464.29	412,464.29		3.68%	3.67%
N.SWAP İŞLEMLERİ								
O.EUROBOND								
FON PORTFÖY DEĞERİ				3,612,066.58	10,940,856.92			
VIOP Sözleşmesi	Kısa	30.08.2022	F_XU0300822	-35.00	-966,262.50	138.93%	-8.62%	-8.60%
ARA GRUP TOPLAMI				-35.00	-966,262.50		-8.62%	-8.60%
Döviz Bakiyeleri	FİNANSBANK A.Ş. VADESİZ USD		USD	16,250.00	270,747.75	-38.93%	2.41%	2.41%
ARA GRUP TOPLAMI				16,250.00	270,747.75		2.41%	2.41%
GRUP TOPLAMI				16,215.00	-695,514.75		-6.20%	-6.19%

2- Net Varlık Değeri Tablosu

	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)		TUTARI(TL)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	10,940,856.92		97.41%	FON TOPLAM DEĞERİ	11,232,238.65	
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	10,940,857.19		97.41%	Toplam Pay Sayısı	10,000,000,000	
B. HAZIR DEĞERLER	272,957.49		2.43%	Dolaşımdaki Pay Sayısı	256,532,485.4	
a) Kasa	0.00	0.00%	0.00%	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	0.	
b) Bankalar	270,747.75	99.19%	2.41%	Merkezdeki Pay Sayısı	9,743,467,514.47	
i) TL Hesaplar	0.00	0.00%	0.00%	Fiyat	0.043785	
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	270,747.75	99.19%	2.41%	(VOB AçıkPozisyon)	9,662,625.00	86.03%
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	0.00	0.00%	0.00%	Pay Sahibi Sayısı	2,525	
c) Diğer Hazır Değerler	2,209.74	0.81%	0.02%	Günlük Yönetim Ücreti	308.89	
C. ALACAKLAR	659,815.44		5.87%	Dünkü Fiyat	0.043649	0.310480%
a) Takastan Alacaklar T1	0.00	0.00%	0.00%			
b) Takastan Alacaklar T2	464,774.42	70.44%	8.28%			
c) Takastan BPP Alacakları	0.00	0.00%	0.00%			
d) Diğer Alacaklar	195,041.02	29.56%	3.47%			
D. DİĞER VARLIKLAR	0.00		0.00%			
E. BORÇLAR	641,391.20		0.00%			
a) Takasa Borçlar T1	0.00	0.00%	0.00%			
b) Takasa Borçlar T2	424,050.00	66.11%	0.00%			
c) Yönetim Ücreti	9,371.38	1.46%	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	207,969.82	32.42%	0.00%			
i) Denetim Ücreti	1,380.26	0.22%	0.00%			
ii) İlan Giderleri	0.00	0.00%	0.00%			
iii) Noter Masrafı	0.00	0.00%	0.00%			
iv) İhraç İzin Gideri	336.98	0.05%	0.00%			
v) Takas Saklama Komisyonu	0.00	0.00%	0.00%			
vi) Diğer	206,252.58	32.16%	0.00%			
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0.00		0.00%			
FON TOPLAM DEĞERİ	11,232,238.65					