

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

Fon Portföy Değeri ve Net Varlık Değeri Tabloları

1- Fon Portföy Değeri Tablosu

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)
A.HİSSE SENEDİ								
Hisse Senedi	AKSA		AKSA	1,250.00	72,312.50	12.18%	0.54%	0.54%
	GWIND		GWIND	6,500.00	51,610.00	8.69%	0.39%	0.39%
	KCAER		KCAER	3,677.00	99,279.00	16.72%	0.75%	0.75%
	KORDS		KORDS	1,500.00	74,070.00	12.47%	0.56%	0.56%
	SISE		SISE	6,500.00	139,750.00	23.54%	1.05%	1.05%
	THYAO		THYAO	2,000.00	93,600.00	15.76%	0.70%	0.70%
	VESBE		VESBE	7,000.00	63,140.00	10.63%	0.47%	0.48%
ARA GRUP TOPLAMI				28,427.00	593,761.50		4.47%	4.47%
GRUP TOPLAMI				28,427.00	593,761.50		4.47%	4.47%
B.BORÇLANMA SENETLERİ								
Devlet Tahvili	T.C.	14.09.2022	TRT140922T17	500,000.00	502,416.46	4.33%	3.78%	3.78%
	T.C.	18.01.2023	TRT180123T10	200,000.00	201,963.58	1.74%	1.52%	1.52%
	T.C.	21.06.2023	TRT210623T10	1,000,000.00	993,998.48	8.57%	7.48%	7.48%
	T.C.	18.10.2023	TRT181023T19	500,000.00	503,926.21	4.35%	3.79%	3.79%
	T.C.	17.07.2024	TRT170724T14	500,000.00	496,894.96	4.29%	3.74%	3.74%
	T.C.	24.07.2024	TRT240724T15	500,000.00	414,399.10	3.57%	3.12%	3.12%
	T.C.	12.03.2025	TRT120325T12	100,000.00	75,266.28	0.65%	0.57%	0.57%
	T.C.	18.06.2025	TRT180625T13	700,000.00	1,872,718.20	16.15%	14.08%	14.09%
	T.C.	01.10.2025	TRT011025T16	500,000.00	404,531.50	3.49%	3.04%	3.04%
	T.C.	11.02.2026	TRT110226T13	400,000.00	301,984.40	2.60%	2.27%	2.27%
	T.C.	24.02.2027	TRT240227T17	1,200,000.00	919,997.64	7.93%	6.92%	6.92%

	T.C.	11.08.2027	TRT110827T16	400,000.00	307,612.88	2.65%	2.31%	2.32%
	T.C.	08.03.2028	TRT080328T15	200,000.00	163,315.40	1.41%	1.23%	1.23%
	T.C.	13.11.2030	TRT131130T14	2,000,000.00	1,440,847.60	12.43%	10.84%	10.84%
ARA GRUP TOPLAMI				8,700,000.00	8,599,872.68		64.67%	64.72%
Özel Sektör Tahvil	Tat Gıda Sanayi A.Ş.	15.05.2023	TRSTATK52314	80,000.00	82,435.82	0.71%	0.62%	0.62%
	Arçelik A.Ş.	07.02.2023	TRSARCL22323	100,000.00	109,169.11	0.94%	0.82%	0.82%
	Arçelik A.Ş.	05.04.2024	TRSARCL42412	200,000.00	210,201.41	1.81%	1.58%	1.58%
	Aygaz A.Ş.	03.02.2023	TRSAYGZ22312	100,000.00	109,300.10	0.94%	0.82%	0.82%
		13.10.2023	TRSENSAE2312	200,000.00	204,168.66	1.76%	1.54%	1.54%
		14.02.2024	TRSOPAS22418	150,000.00	154,941.39	1.34%	1.17%	1.17%
	Tat Gıda	20.06.2023	TRSTATK62313	100,000.00	101,515.83	0.88%	0.76%	0.76%
	TÜPRAS	03.02.2023	TRSTPRS22312	150,000.00	153,813.95	1.33%	1.16%	1.16%
ARA GRUP TOPLAMI				1,080,000.00	1,125,546.26		8.46%	8.47%
Finansman Bonosu	A1 CAPITAL YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	16.08.2022	TRFA1CP82211	150,000.00	145,744.06	1.26%	1.10%	1.10%
	Hektaş Ticaret T.A.Ş.	16.08.2022	TRFHEKT82216	100,000.00	97,708.43	0.84%	0.73%	0.74%
	Otokoç Otomotiv Sanayi ve Ticaret A.Ş.	15.09.2022	TRFOTKO92210	100,000.00	95,824.29	0.83%	0.72%	0.72%
	Tam Finans Faktoring A.Ş.	03.08.2022	TRFTAMF82214	100,000.00	98,016.63	0.85%	0.74%	0.74%
	Tam Finans Faktoring A.Ş.	01.09.2022	TRFTAMF92213	100,000.00	95,810.78	0.83%	0.72%	0.72%
	Türk Ekonomi Bankası A.Ş.	22.07.2022	TRFTEBK72228	100,000.00	98,899.94	0.85%	0.74%	0.74%
		11.08.2022	TRFKCTF82214	200,000.00	235,148.06	2.03%	1.77%	1.77%
		01.07.2022	TRFMCBF72219	200,000.00	240,289.40	2.07%	1.81%	1.81%
	QUA Granite Hayal Yapı ve Ürünleri San. ve Tic. A.Ş.	06.10.2022	TRFQAGRE2214	300,000.00	311,879.15	2.69%	2.35%	2.35%
ARA GRUP TOPLAMI				1,350,000.00	1,419,320.74		10.67%	10.68%
Banka Bonosu		02.09.2026	TRT020926T17	500,000.00	450,311.30	3.88%	3.39%	3.39%
ARA GRUP TOPLAMI				500,000.00	450,311.30		3.39%	3.39%
GRUP TOPLAMI				11,630,000.00	11,595,050.98		87.20%	87.26%
C. KATILMA BELGESİ								
Katılma Belgesi			RR9	180.00	277,558.94	49.84%	2.09%	2.09%
			RP6	12,850.00	279,364.20	50.16%	2.10%	2.10%
ARA GRUP TOPLAMI				13,030.00	556,923.14		4.19%	4.19%
GRUP TOPLAMI				13,030.00	556,923.14		4.19%	4.19%
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		01.07.2022		161,082.93	161,082.93	100.00%	1.21%	1.21%
ARA GRUP TOPLAMI				161,082.93	161,082.93		1.21%	1.21%
GRUP TOPLAMI				161,082.93	161,082.93		1.21%	1.21%
L.VARANT İŞLEMLERİ								
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ								
VIOP Nakit				140,689.29	140,689.29	100.00%	1.06%	1.06%
ARA GRUP TOPLAMI				140,689.29	140,689.29		1.06%	1.06%
GRUP TOPLAMI				140,689.29	140,689.29		1.06%	1.06%
N.SWAP İŞLEMLERİ								
O.EUROBOND FON PORTFÖY DEĞERİ				11,988,229.22	13,047,507.85			
Döviz Bakiyeleri	FİNANSBANK A.Ş. VADESİZ USD		USD	15,000.00	249,921.00	100.00%	1.88%	1.88%
ARA GRUP TOPLAMI				15,000.00	249,921.00		1.88%	1.88%
GRUP TOPLAMI				15,000.00	249,921.00		1.88%	1.88%

2- Net Varlık Değeri Tablosu

	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)		TUTARI(TL)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	13,047,507.85		98.19%	FON TOPLAM DEĞERİ	13,287,512.16	
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	13,047,508.71		98.19%	Toplam Pay Sayısı	10,000,000,000	
B. HAZIR DEĞERLER	251,990.40		1.90%	Dolaşımdaki Pay Sayısı	508,226,795.94	
a) Kasa	0.00	0.00%	0.00%	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	0.	
b) Bankalar	249,921.00	99.18%	1.88%	Merkezdeki Pay Sayısı	9,491,773,204.07	
i) TL Hesaplar	0.00	0.00%	0.00%	Fiyat	0.026145	
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	249,921.00	99.18%	1.88%	(VOB AçıkPozisyon)	0.00	0.00%
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	0.00	0.00%	0.00%	Pay Sahibi Sayısı	2,653	
c) Diğer Hazır Değerler	2,069.40	0.82%	0.02%	Günlük Yönetim Ücreti	365.41	
C. ALACAKLAR	3,055.10		0.02%	Dünkü Fiyat	0.026163	-0.067863%
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	3,055.10	100.00%	0.05%			
D. DİĞER VARLIKLAR	0.00		0.00%			
E. BORÇLAR	15,041.19		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	11,091.08	73.74%	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	3,950.11	26.26%	0.00%			
i) Denetim Ücreti	712.68	4.74%	0.00%			
ii) İlan Giderleri	0.00	0.00%	0.00%			
iii) Noter Masrafı	0.00	0.00%	0.00%			
iv) İhraç İzin Gideri	398.64	2.65%	0.00%			
v) Takas Saklama Komisyonu	0.00	0.00%	0.00%			
vi) Diğer	2,838.79	18.87%	0.00%			
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0.00		0.00%			
FON TOPLAM DEĞERİ	13,287,512.16					