

CİGNA SAĞLIK HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
BİRİNCİ HİSSE SENEDİ 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	170,000.00	9,834,500.00	4.35%	4.23%	4.05%
	AKSEN		AKSEN	400,000.00	9,632,000.00	4.26%	4.14%	3.97%
	ALARK		ALARK	290,000.00	9,512,000.00	4.21%	4.09%	3.92%
	ALKIM		ALKIM	0.06	1.24	0.00%	0.00%	0.00%
	BIMAS		BIMAS	122,500.00	9,904,125.00	4.38%	4.26%	4.08%
	EREGL		EREGL	275,000.00	7,463,500.00	3.30%	3.21%	3.08%
	FROTO		FROTO	34,500.00	9,211,500.00	4.08%	3.96%	3.80%
	GWIND		GWIND	1,200,000.00	9,528,000.00	4.22%	4.09%	3.93%
	ISCTR		ISCTR	1,700,000.87	7,446,003.81	3.30%	3.20%	3.07%
	KCAER		KCAER	414,130.00	11,181,510.00	4.95%	4.81%	4.61%
	KCHOL		KCHOL	255,000.00	9,333,000.00	4.13%	4.01%	3.85%
	KORDS		KORDS	192,500.00	9,505,650.00	4.21%	4.09%	3.92%
	MAVI		MAVI	185,000.00	9,703,250.00	4.30%	4.17%	4.00%
	ODAS		ODAS	3,300,000.00	9,537,000.00	4.22%	4.10%	3.93%
	PGSUS		PGSUS	107,500.00	18,382,500.00	8.14%	7.90%	7.57%
	SAHOL		SAHOL	500,000.00	9,455,000.00	4.19%	4.06%	3.90%
	SISE		SISE	675,000.00	14,512,500.00	6.42%	6.24%	5.98%
	TAVHL		TAVHL	187,500.00	9,330,000.00	4.13%	4.01%	3.84%
	THYAO		THYAO	470,000.00	21,996,000.00	9.74%	9.45%	9.06%
	TKFEN		TKFEN	375,000.00	8,107,500.00	3.59%	3.48%	3.34%
	TKFEN		TKFEN	25,000.00	540,500.00	0.24%	0.23%	0.22%
			TKFEN	400,000.00	8,648,000.00	3.83%	3.72%	3.56%
	TUPRS		TUPRS	55,000.00	14,547,500.00	6.44%	6.25%	5.99%
	VESBE		VESBE	800,000.00	7,216,000.00	3.19%	3.10%	2.97%
ARA GRUP TOPLAMI				11,733,630.93	225,879,540.06		97.07%	93.07%
GRUP TOPLAMI				11,733,630.93	225,879,540.06		97.07%	93.07%

B.BORÇLANMA SENETLERİ								
C. KATILMA BELGESİ								
D. OPSİYON İŞLEMLER								
E.YABANCI HİSSE								
F.TERS REPO								
Devlet Tahvili Repo	T.C.	01.07.2022	TRT030523T13	4,001,578.08	4,001,578.08	100.00%	1.72%	1.65%
ARA GRUP TOPLAMI				4,001,578.08	4,001,578.08		1.72%	1.65%
GRUP TOPLAMI				4,001,578.08	4,001,578.08		1.72%	1.65%
G.KATILIM HESABI								
H.VADELİ MEVDUAT								
I.KIYMETLİ MADEN								
J.YABANCI TAHVİL								
K.BORSA PARA PİYASASI								
BPP		01.07.2022		759,390.94	759,390.94	100.00%	0.33%	0.31%
ARA GRUP TOPLAMI				759,390.94	759,390.94		0.33%	0.31%
GRUP TOPLAMI				759,390.94	759,390.94		0.33%	0.31%
L.VARANT İŞLEMLERİ								
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ								
VIOP Nakit				2,051,421.29	2,051,421.29	100.00%	0.88%	0.85%
ARA GRUP TOPLAMI				2,051,421.29	2,051,421.29		0.88%	0.85%
GRUP TOPLAMI				2,051,421.29	2,051,421.29		0.88%	0.85%
N.SWAP İŞLEMLERİ								
O.EUROBOND								
FON PORTFÖY DEĞERİ				18,546,021.24	232,691,930.37			
VIOP Sözleşmesi	Kısa	30.08.2022	F_XU0300822	-200.00	-5,521,500.00	100.00%	-2.37%	-2.28%
ARA GRUP TOPLAMI				-200.00	-5,521,500.00		-2.37%	-2.28%
GRUP TOPLAMI				-200.00	-5,521,500.00		-2.37%	-2.28%

2- Net Varlık Değeri Tablosu

	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)			TUTARI(TL)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	232,691,930.37		95.88%		FON TOPLAM DEĞERİ	242,694,571.15	
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	232,691,930.40		95.88%		Toplam Pay Sayısı	10,000,000,000	
B. HAZIR DEĞERLER	1,879.91		0.00%		Dolaşımdaki Pay Sayısı	1,166,337,345.29	
a) Kasa	0.00	0.00%	0.00%		Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	0.	
b) Bankalar	0.00	0.00%	0.00%		Merkezdeki Pay Sayısı	8,833,662,645.62	
i) TL Hesaplar	0.00	0.00%	0.00%		Fiyat	0.208083	
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	0.00	0.00%	0.00%		(VOB AçıkPozisyon)	55,215,000.00	22.75%
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	0.00	0.00%	0.00%		Pay Sahibi Sayısı	14,245	
c) Diğer Hazır Değerler	1,879.91	100.00%	0.00%		Günlük Yönetim Ücreti	11,649.00	
C. ALACAKLAR	12,536,810.74		5.17%		Dünkü Fiyat	0.207439	0.310388%
a) Takastan Alacaklar T1	9,009,571.67	71.86%	7.42%				
b) Takastan Alacaklar T2	2,920,884.72	23.30%	2.41%				
c) Takastan BPP Alacakları	0.00	0.00%	0.00%				
d) Diğer Alacaklar	606,354.35	4.84%	0.50%				
D. DİĞER VARLIKLAR	0.00		0.00%				
E. BORÇLAR	2,536,049.87		0.00%				
a) Takasa Borçlar T1	1,471,050.00	58.01%	0.00%				
b) Takasa Borçlar T2	558,500.00	22.02%	0.00%				
c) Yönetim Ücreti	353,040.80	13.92%	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	153,459.07	6.05%	0.00%				
i) Denetim Ücreti	0.00	0.00%	0.00%				
ii) İlan Giderleri	0.00	0.00%	0.00%				
iii) Noter Masrafı	0.00	0.00%	0.00%				
iv) İhraç İzin Gideri	7,280.84	0.29%	0.00%				
v) Takas Saklama Komisyonu	0.00	0.00%	0.00%				
vi) Diğer	146,178.23	5.76%	0.00%				
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0.00		0.00%				
FON TOPLAM DEĞERİ	242,694,571.15						