

GMM Α/Κ ΒΡΑΧΥΠΡΟΘΕΣΜΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			620.965,93
NATIONAL BANK OF CYPRUS CASH IN EURO			749.870,00
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.370.835,93
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.75 1/11/2015	6.500,0000	99,34900000	645.768,50
- Isin: XS0554655505			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-NOV-10 - 01-NOV-15 Επιδόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			645.768,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			645.768,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.016.604,43
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
GE 2.875 17/9/2015	1.000,0000	101,28900000	101.289,00
- Isin: XS0541454467			
- Εκδότης: GE CAPITAL EURO FUNDING			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-SEP-10 - 17-SEP-15 Επιδόκιο: 2.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE 4,625% 20/05/2016	1.500,0000	98,32700000	147.490,50
- Isin: XS0275776283			
- Εκδότης: OTE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-NOV-06 - 20-MAY-16 Επιδόκιο: 4.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
TESCO PLC 12/9/2016	2.000,0000	107,12500000	214.250,00
- Isin: XS0386772684			
- Εκδότης: TESCO PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-SEP-09 - 12-SEP-16 Επιδόκιο: 5.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FADE 2.25 17/12/2016	1.000,0000	103,46300000	103.463,00
- Isin: ES0378641189			
- Εκδότης: FADE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-NOV-13 - 17-DEC-16 Επιδόκιο: 2.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLENCORE 5.25 22/3/2017	1.500,0000	109,01300000	163.519,50
- Isin: XS0495973470			
- Εκδότης: GLENCORE FINANCE EUROPE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-10 - 22-MAR-17 Επιδόκιο: 5.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			

SPGB 2.1 30/4/2017	1.000,0000	104,07800000	104.078,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: ES0000012412 - Εκδότης: BONOS Y OBLIG DEL ESTADO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-NOV-13 - 30-APR-17 Επιτόκιο: 2.1% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
TELECOM ITALIA 20/9/2017	1.500,0000	108,37500000	162.562,50
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0831389985 - Εκδότης: TELECOM ITALIA FIN SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-SEP-13 - 20-SEP-17 Επιτόκιο: 4.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
OBRIGACOES DO TESOURO 16/10/2017	4.000,0000	109,79600000	439.184,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: PTOTEL0E0010 - Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOURO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-MAY-07 - 16-OCT-17 Επιτόκιο: 4.35% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
FINMECCANICA 5/12/2017	1.000,0000	108,00000000	108.000,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0861828407 - Εκδότης: FINMECCANICA SPA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-13 - 05-DEC-17 Επιτόκιο: 4.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
FADE 3.875 17/03/2018	2.000,0000	110,28100000	220.562,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: ES0378641155 - Εκδότης: FADE - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-13 - 17-MAR-18 Επιτόκιο: 3.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	137,49484394	72.356,66
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: GB00BBHXPS12 - Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A - Πρόσθετοι Όροι: 			
BHARTI 4 10/12/18	2.000,0000	108,81200000	217.624,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0997979249 - Εκδότης: BHARTI AIRTEL INTERNATIO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-DEC-13 - 10-DEC-18 Επιτόκιο: 4% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
BUONI POLIENALI DEL TES 01/2/2019	2.500,0000	114,65800000	286.645,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: IT0003493258 - Εκδότης: BUONI POLIENALI DEL TES - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-FEB-03 - 01-FEB-19 Επιτόκιο: 4.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2u - Πρόσθετοι Όροι: 			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			2.341.024,16

ZERO COUPON

CYPRUS TBILL 08/5/2015	4.000,0000	99,50600000	398.024,00
- Isin: CY0145520819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-FEB-15 - 08-MAY-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CERT DI CREDITO DEL TES 30/6/2015	600,0000	99,98500000	59.991,00
- Isin: IT0004938186			
- Εκδότης: CERT DI CREDITO DEL TES			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JUN-13 - 30-JUN-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2u			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BILHETES DO TESOURO 20/11/2015	1.750,0000	99,97200000	174.951,00
- Isin: PTPBTHGE0026			
- Εκδότης: BILHETES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-NOV-14 - 20-NOV-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BILHETES DO TESOURO 18/12/2015	1.200,0000	99,96800000	119.961,60
- Isin: PTPBTIGE0025			
- Εκδότης: BILHETES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-14 - 18-DEC-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			752.927,60
ΣΥΝΟΛΟ II.1			3.093.951,76
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			3.093.951,76
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			5.110.556,19
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			40.689,75
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			5.151.245,94

GMM GLOBAL MONEY MANAGERS LTD
Στασίνου 36, 2003 Λευκωσία, Κύπρος