

GMM DEVELOPMENT BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	81.323,5500	0,89373492	72.681,70
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			676.718,56
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			179.970,00
CASH ACCOUNT IN GBP	94.040,8300	1,40567894	132.191,21
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.061.561,47
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.75 1/11/2015	1.000,0000	99,77300000	99.773,00
- Isin: XS0554655505			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-NOV-10 - 01-NOV-15			Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4.75 25/6/2019	2.500,0000	103,36000000	258.400,00
- Isin: XS1081101807			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUN-14 - 25-JUN-19			Επιτόκιο: 4.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	1.000,0000	102,82400000	102.824,00
- Isin: XS0483954144			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-10 - 03-FEB-20			Επιτόκιο: 4.625%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	2.000,0000	100,19800000	200.396,00
- Isin: XS1227247191			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-15 - 06-MAY-22			Επιτόκιο: 3.875%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			661.393,00
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 08/7/2015	2.000,0000	99,90600000	199.812,00
- Isin: CY0145640815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-APR-15 - 08-JUL-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 17/7/2015	2.000,0000	99,80100000	199.602,00
- Isin: CY0145780819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JUN-15 - 17-JUL-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			

CYPRUS TBILL 07/8/2015	2.000,0000	99,55900000	199.118,00
- Isin: CY0145700817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-15 - 07-AUG-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			598.532,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			1.259.925,00
3. ΛΟΙΠΟΙ ΟΡΓΑΝΙΣΜΟΙ ΣΥΛΛΟΓΙΚΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ			
GMM MARATHON ASSETS CYPRUS BOND FUND	5.209,3100	9,29210000	48.405,43
ΣΥΝΟΛΟ I.3			48.405,43
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.369.891,90
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
MARGIN IN GBP/BETA	19.770,7500	1,40567894	27.791,33
ΣΥΝΟΛΟ II.1			27.791,33
2. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	2.100,0000	100,00000000	210.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17			Επιτόκιο: 7.45%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
TELEMAR 5.125 15/12/2017	1.500,0000	103,75000000	155.625,00
- Isin: XS0569301327			
- Εκδότης: TELEMAR NORTE LESTE SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-10 - 15-DEC-17			Επιτόκιο: 5.125%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EUROPEAN INVT 1% 15/3/2018	600,0000	89,10537135	53.463,22
- Isin: US298785GA86			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JAN-13 - 15-MAR-18			Επιτόκιο: 1%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FRIGOGLASS 8,25% 15/05/2018	2.000,0000	94,20800000	188.416,00
- Isin: XS0932291007			
- Εκδότης: FRIGOGLASS FINANCE BV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-13 - 15-MAY-18			Επιτόκιο: 8.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.631,2500	140,56789429	369.869,27
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	2.000,0000	102,62500000	205.250,00
- Isin: XS0982710153			
- Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-FEB-19			Επιτόκιο: 5.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			

GLAXOSMITHKLINE CAPITAL 02/12/2019	1.000,0000	100,08000000	100.080,00
- Isin: XS1147600305			
- Εκδότης: GLAXOSMITHKLINE CAPITAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-14 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: .625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VESTAS WIND 11/3/2022	1.500,0000	96,06000000	144.090,00
- Isin: XS1197336263			
- Εκδότης: VESTAS WIND SYSTEMS A/S			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-MAR-15 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CITIGROUP 28/1/2025	1.500,0000	96,53300000	144.799,50
- Isin: XS1173792059			
- Εκδότης: CITIGROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 28-JAN-25 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLENCORE 1.75 17/3/2025	1.000,0000	91,09200000	91.092,00
- Isin: XS1202849086			
- Εκδότης: GLENCORE FINANCE EUROPE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-15 - 17-MAR-25 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			1.662.684,99
ZERO COUPON			
BILHETES DO TESOURO 18/12/2015	1.500,0000	99,95900000	149.938,50
- 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			149.938,50
ΣΥΝΟΛΟ II.2			1.812.623,49
3. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
MIKRO KAPITAL SARL 10/12/2015	2.500,0000	100,00000000	250.000,00
- Isin: XS1075048691			
- Εκδότης: MIKRO KAPITAL SARL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-JUN-14 - 10-DEC-15 Επιτόκιο: 8.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			250.000,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			250.000,00
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
LYXOR JPX-NK400 DLYHDG-C EUR	900,0000	118,62000000	106.758,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			106.758,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			2.197.172,82
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			4.567.064,72
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-38.873,20
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			4.528.191,52

III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EURO FX GBP CURR FUT sep15	3,0000	0,70945000	373.972,10
ΣΥΝΟΛΟ III.1			373.972,10
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			373.972,10
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			373.972,10

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