

GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ HIGH YIELD

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	3.002,1200	0,89373492	2.683,10
CASH ACCOUNT IN GBP	36.001,6900	1,40567894	50.606,82
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.522.084,42
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.575.374,34
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.75 25/6/2019	4.500,0000	103,36000000	465.120,00
- Isin: XS1081101807			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUN-14 - 25-JUN-19 Επιδόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	2.000,0000	102,82400000	205.648,00
- Isin: XS0483954144			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-10 - 03-FEB-20 Επιδόκιο: 4.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	5.000,0000	100,19800000	500.990,00
- Isin: XS1227247191			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-15 - 06-MAY-22 Επιδόκιο: 3.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			1.171.758,00
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 17/7/2015	5.000,0000	99,80100000	499.005,00
- Isin: CY0145780819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JUN-15 - 17-JUL-15 Επιδόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 07/8/2015	2.500,0000	99,55900000	248.897,50
- Isin: CY0145700817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-15 - 07-AUG-15 Επιδόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 4/9/2015	1.000,0000	99,23800000	99.238,00
- Isin: CY0145760811			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-JUN-15 - 04-SEP-15 Επιδόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			847.140,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			2.018.898,50

3. ΛΟΙΠΟΙ ΟΡΓΑΝΙΣΜΟΙ ΣΥΛΛΟΓΙΚΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ

GMM MARATHON ASSETS CYPRUS BOND FUND	10.418,6200	9,29210000	96.810,86
ΣΥΝΟΛΟ Ι.3			96.810,86
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			3.691.083,70

II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ

MARGIN IN GBP/BETA	55.443,9400	1,40567894	77.936,38
MARGIN IN USD/BETA	42.351,5500	0,89373492	37.851,06
ΣΥΝΟΛΟ ΙΙ.1			115.787,44

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:			
OTE PLC 7,875% 07/02/2018	1.000,0000	92,58000000	92.580,00
- Isin: XS0885718782			
- Εκδότης: OTE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-FEB-13 - 07-FEB-18 Επιτόκιο: 7.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
LUKOIL INTL 24/4/2018	2.000,0000	85,68683528	171.373,67
- Isin: XS0919502434			
- Εκδότης: LUKOIL INTL FINANCE BV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-13 - 24-APR-18 Επιτόκιο: 3.416%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FRIGOGLASS 8,25% 15/05/2018	4.000,0000	94,20800000	376.832,00
- 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	7.367,5000	140,56789429	1.035.633,96
- 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	3.000,0000	102,62500000	307.875,00
- 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:			
GOBAIN 5.625 15/5/2019	2.000,0000	101,25000000	202.500,00
- Isin: XS1028957469			
- Εκδότης: SGD GROUP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-14 - 15-MAY-19 Επιτόκιο: 5.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			

MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019	3.000,0000	81,15300000	243.459,00
- Isin: XS1066486629			
- Εκδότης: MOTOR OIL FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-14 - 15-MAY-19 Επιτόκιο: 5.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
TTMTIN 4.625% 30/4/2020	2.000,0000	91,16096166	182.321,92
- Isin: XS1121907676			
- Εκδότης: TATA MOTORS LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-OCT-14 - 30-APR-20 Επιτόκιο: 4.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CABLE COMM 7.5 1/11/2020	2.000,0000	104,75000000	209.500,00
- Isin: XS0954673777			
- Εκδότης: CABLE COMM SYST NV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-13 - 01-NOV-20 Επιτόκιο: 7.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FNCIM 4.5% 19/1/2021	2.280,0000	106,75000000	243.390,00
- Isin: XS0999654873			
- Εκδότης: FINMECCANICA SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-13 - 19-JAN-21 Επιτόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
COMMERZBANK 16/3/2021	2.000,0000	119,50000000	239.000,00
- Isin: DE000CB83CF0			
- Εκδότης: COMMERZBANK AG			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-MAR-11 - 16-MAR-21 Επιτόκιο: 7.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CEMEX FINANCE LLC 1/4/2021	2.000,0000	102,62500000	205.250,00
- Isin: XS1028960174			
- Εκδότης: CEMEX FINANCE LLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-APR-14 - 01-APR-21 Επιτόκιο: 5.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIAGIM 4.625 30/4/2021	3.000,0000	102,75000000	308.250,00
- Isin: XS1061086846			
- Εκδότης: PIAGGIO & C SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-14 - 30-APR-21 Επιτόκιο: 4.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL 15/5/2021	1.000,0000	85,60900000	85.609,00
- Isin: XS1064899120			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 15-MAY-21 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BHARTI 3.375 20/05/21	2.000,0000	104,83000000	209.660,00
- Isin: XS1028954953			
- Εκδότης: BHARTI AIRTEL INTERNATIO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-14 - 20-MAY-21 Επιτόκιο: 3.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			

THOMAS COOK 15/6/2021	2.000,0000	103,50000000	207.000,00
- Isin: XS1172436211			
- Εκδότης: THOMAS COOK FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-JAN-15 - 15-JUN-21 Επιτόκιο: 6.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF COLOMBIA 12/7/2021	2.000,0000	93,48914112	186.978,28
- Isin: US195325BN40			
- Εκδότης: REPUBLIC OF COLOMBIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-JUL-11 - 12-JUL-21 Επιτόκιο: 4.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GM 4.375 25/9/2021	1.000,0000	92,72499777	92.725,00
- Isin: US37045XAAQ97			
- Εκδότης: GENERAL MOTORS FINL CO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-SEP-14 - 25-SEP-21 Επιτόκιο: 4.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VESTAS WIND 11/3/2022	2.000,0000	96,06000000	192.120,00
- 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:			
SAPSI 3.375 1/4/2022	2.000,0000	95,00000000	190.000,00
- Isin: XS1117298676			
- Εκδότης: SAPPI PAPIER HOLDNG GMBH			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-MAR-15 - 01-APR-22 Επιτόκιο: 3.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FIAT 4.75 15/07/22	2.900,0000	104,87500000	304.137,50
- Isin: XS1088515207			
- Εκδότης: FIAT CHRYSLER FINANCE EU			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-22 Επιτόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
UNICREDIT SPA 31/10/2022	2.000,0000	115,75000000	231.500,00
- Isin: XS0849517650			
- Εκδότης: UNICREDIT SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-OCT-12 - 31-OCT-22 Επιτόκιο: 6.95%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VMED 15/1/2025	2.500,0000	99,37500000	248.437,50
- Isin: XS1169920193			
- Εκδότης: VIRGIN MEDIA FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 15-JAN-25 Επιτόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EDP FIN, 22/4/25	1.000,0000	90,25000000	90.250,00
- Isin: XS1222590488			
- Εκδότης: EDP FINANCE BV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-APR-15 - 21-APR-25 Επιτόκιο: 2%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			

OBRIGACOES DO TESOURO 15/04/2037	1.000,0000	105,37000000	105.370,00
- Isin: PTOTESOE0007			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-06 - 15-APR-37 Επιτόκιο: 4.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			6.171.752,83
STEPPED			
ITCIT 6.625 19/3/2020	2.000,0000	112,87500000	225.750,00
- Isin: XS0496716282			
- Εκδότης: ITALCEMENTI FINANCE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-MAR-10 - 19-MAR-20 Επιτόκιο: 6.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			225.750,00
ΣΥΝΟΛΟ II.2			6.397.502,83
3. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
MIKRO KAPITAL SARL 10/12/2015	5.000,0000	100,00000000	500.000,00
- 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			500.000,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			500.000,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			7.013.290,27
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			10.704.373,97
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-24.460,05
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			10.679.913,92
III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EUR FX USD FUT SEP15	5,0000	1,11560000	623.156,67
EURO FX GBP CURR FUT sep15	9,0000	0,70945000	1.121.916,29
ΣΥΝΟΛΟ III.1			1.745.072,96
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			1.745.072,96
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			1.745.072,96

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