

GMM MARATHON CYPRUS ASSETS BOND FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	1,5500	0,90073861	1,40
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			37.532,09
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			3,00
CASH ACCOUNT IN GBP	14.219,7000	1,20992136	17.204,72
ΣΥΝΟΛΟ I.1			54.741,21
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.5 4/1/2017	100,0000	100,71000000	10.071,00
- Isin: CY0140160819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JAN-07 - 04-JAN-17 Επιδόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4.5 2/4/2017	100,0000	100,79000000	10.079,00
- Isin: CY0140330818			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-APR-07 - 02-APR-17 Επιδόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 2 18/1/2018	1.550,0000	99,71050000	154.551,28
- Isin: CY0146220815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18 Επιδόκιο: 2%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 6.10 20/4/2020	4.000,0000	109,27733700	437.109,35
- Isin: CY0049570811			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-APR-05 - 20-APR-20 Επιδόκιο: 6.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	8.000,0000	102,61250000	820.900,00
- 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:			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	6.000,0000	99,39500000	596.370,00
- Isin: CY0146250812			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-23 Επιδόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	10.600,0000	103,49450000	1.097.041,70
- Isin: XS1314321941			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-15 - 04-NOV-25 Επιδόκιο: 4.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			3.126.122,33

ZERO COUPON

CYPRUS TBILL 5/8/2016	4.000,0000	99,75200000	399.008,00
- Isin: CY0146480815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-16 - 05-AUG-16 Επιδόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 2/9/2016	5.500,0000	99,50900000	547.299,50
- Isin: CY0146530817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-16 - 02-SEP-16 Επιδόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			946.307,50

ΣΥΝΟΛΟ Ι.2

4.072.429,83

ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)

4.127.171,04

II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ

FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	350,0000	100,00000000	35.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUANTITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17 Επιδόκιο: 7.45%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			35.000,00

ΣΥΝΟΛΟ II.1

35.000,00

2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	90,74410163	191.016,33
- Isin: GB00BBHXP512			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιδόκιο: 9%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			191.016,33

ΣΥΝΟΛΟ II.2

191.016,33

3. MARGIN

MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			1.223,01
MARGIN IN GBP/ΒΕΤΑ	14.412,5000	1,20992136	17.437,99
ΣΥΝΟΛΟ II.3			18.661,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			244.677,33

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

4.371.848,37

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

121.641,28

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

4.493.489,65

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EURO FX GBP CURR sep16	2,0000	0,83845000	253.614,64
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			253.614,64
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			253.614,64
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			253.614,64