

GMM MARATHON CYPRUS ASSETS BOND FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			776.462,59
CASH ACCOUNT IN GBP	4.738,4300	1,36249063	6.456,07
ΣΥΝΟΛΟ I.1			782.918,66
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 4.625 3/2/2020	3.450,0000	108,15350000	373.129,58
- 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	8.900,0000	104,18550000	927.250,95
- 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:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	9.600,0000	104,57700000	1.003.939,20
- 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			2.324.469,73
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 08/1/2016	1.000,0000	99,95250000	99.952,50
- Isin: CY0145860819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUL-15 - 08-JAN-16 Επιδόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			

CYPRUS TBILL 8/01/2016	1.000,0000	99,95250000	99.952,50
- Isin: CY0145990814			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-OCT-15 - 08-JAN-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 5/02/2016	2.000,0000	99,78500000	199.570,00
- Isin: CY0146040817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-NOV-15 - 05-FEB-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 4/03/2016	2.000,0000	99,61500000	199.230,00
- Isin: CY0146080813			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-NOV-15 - 04-MAR-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			598.705,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			2.923.174,73
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			3.706.093,39
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			5.843,18
ΣΥΝΟΛΟ II.1			5.843,18
2. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	350,0000	100,00000000	35.000,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			35.000,00
ΣΥΝΟΛΟ II.2			35.000,00
3. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	102,18679747	215.103,21
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			215.103,21
ΣΥΝΟΛΟ II.3			215.103,21
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			255.946,39
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			3.962.039,78
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-3.691,13
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			3.958.348,65