

**GMM MARATHON CYPRUS ASSETS BOND FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016**

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ		ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>				
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>				
CASH ACCOUNT IN USD	1,5500		0,87834870	1,36
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO				600.893,55
CASH ACCOUNT IN GBP	14.219,7000		1,26334407	17.964,37
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>				<b>618.859,28</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>				
<b>FIXED</b>				
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		Επιτόκιο: 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		Επιτόκιο: 4.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-				
- Πρόσθετοι Όροι:				
CYPRUS 2 18/1/2018	1.550,0000		98,45500000	152.605,25
- Isin: CY0146220815				
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18		Επιτόκιο: 2%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-				
- Πρόσθετοι Όροι:				
CYPRUS 4.625 3/2/2020	450,0000		105,70400000	47.566,80
- 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	8.000,0000		102,42250000	819.380,00
- 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:				
CYPRUS 3.25 18/1/2023	6.000,0000		97,78200000	586.692,00
- Isin: CY0146250812				
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-23		Επιτόκιο: 3.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-				
- Πρόσθετοι Όροι:				
REP OF CYPRUS 4/11/2025	10.600,0000		103,21850000	1.094.116,10
- Isin: XS1314321941				
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-15 - 04-NOV-25		Επιτόκιο: 4.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+				
- Πρόσθετοι Όροι:				
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>				<b>2.720.510,15</b>

**ZERO COUPON**

CYPRUS TBILL 08/4/2016	2.000,0000	99,93400000	199.868,00
- Isin: CY0146200817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JAN-16 - 08-APR-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 6/5/2016	1.500,0000	99,71700000	149.575,50
- Isin: CY0146270810			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-16 - 06-MAY-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON</b>			<b>349.443,50</b>

**ΣΥΝΟΛΟ Ι.2**

**3.069.953,65**

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)**

**3.688.812,93**

**II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ**

**1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ**

<b>FIXED</b>			
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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>35.000,00</b>

**ΣΥΝΟΛΟ II.1**

**35.000,00**

**2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ**

<b>FIXED</b>			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	75,80064431	159.560,36
- Isin: GB00BBHXP512			
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>159.560,36</b>

**ΣΥΝΟΛΟ II.2**

**159.560,36**

**3. MARGIN**

MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			5.843,18
---------------------------------	--	--	----------

**ΣΥΝΟΛΟ II.3** **5.843,18**

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)** **200.403,54**

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)** **3.889.216,47**

**ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ** **54.951,11**

**ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ** **3.944.167,58**

**ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)** **0,00**

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