

GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ ΥΨΗΛΗΣ ΠΙΣΤΟΛΗΠΤΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

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	96,4100	0,89373492	86,16
CASH ACCOUNT IN CAD	2.776,7300	0,72259556	2.006,45
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			934.454,11
CASH ACCOUNT IN GBP	15.989,9400	1,40567894	22.476,72
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			48,22
ΣΥΝΟΛΟ I.1			959.071,66
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
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 Επιδόκιο: 3.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			200.396,00
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 17/7/2015	4.000,0000	99,80100000	399.204,00
- 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	7.000,0000	99,55900000	696.913,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			1.096.117,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			1.296.513,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.255.584,66
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
MARGIN IN GBP/BETA	25.121,0700	1,40567894	35.312,16
MARGIN IN USD/BETA	28.898,5000	0,89373492	25.827,60
ΣΥΝΟΛΟ II.1			61.139,76
2. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	1.750,0000	100,00000000	175.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17 Επιδόκιο: 7.45%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			

YUM 6.25 15/3/2018	1.300,0000	98,78183931	128.416,39
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US988498AC50 - Εκδότης: YUM! BRANDS INC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-MAR-08 - 15-MAR-18 Επιτόκιο: 6.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	3.157,5000	140,56789429	443.843,13
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
BHARTI 4 10/12/18	2.000,0000	107,00300000	214.006,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0997979249 - Εκδότης: BHARTI AIRTEL INTERNATIO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-DEC-13 - 10-DEC-18 Επιτόκιο: 4% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
TORON. DOM BANK 5/11/2019	1.200,0000	89,63714362	107.564,57
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US89114QAV05 - Εκδότης: TORONTO-DOMINION BANK - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-NOV-14 - 05-NOV-19 Επιτόκιο: 2.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ALTRIA 2.625 14/1/2020	1.500,0000	88,79613907	133.194,21
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US02209SAT06 - Εκδότης: ALTRIA GROUP INC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-NOV-14 - 14-JAN-20 Επιτόκιο: 2.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GOLDMAN SACHS 19/8/2020	1.300,0000	106,59200000	138.569,60
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0963375232 - Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-AUG-13 - 19-AUG-20 Επιτόκιο: 2.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
SINOPEC 17/10/2020	2.000,0000	107,03400000	214.068,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0982303785 - Εκδότης: SINOPEC GRP OVERSEA 2013 - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-OCT-13 - 17-OCT-20 Επιτόκιο: 2.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
PETROLEOS MEXICANOS 27/11/2020	1.000,0000	105,03100000	105.031,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0997484430 - Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-NOV-13 - 27-NOV-20 Επιτόκιο: 3.125% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
BHARTI 3.375 20/05/21	1.000,0000	104,83000000	104.830,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			

KELLOGG 1.75 24/5/2021	2.000,0000	102,17000000	204.340,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1070075988 - Εκδότης: KELLOGG CO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-MAY-14 - 24-MAY-21 Επιτόκιο: 1.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
LOCKHEED 15/9/2021	1.000,0000	91,75708285	91.757,08
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US539830AY52 - Εκδότης: LOCKHEED MARTIN CORP - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-SEP-11 - 15-SEP-21 Επιτόκιο: 3.35% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
JPM 1.375% 16/9/2021	1.000,0000	100,09300000	100.093,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1110449458 - Εκδότης: JPMORGAN CHASE & CO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-SEP-14 - 16-SEP-21 Επιτόκιο: 1.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
HUTCH 31/10/2021	1.500,0000	99,64600000	149.469,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1132402709 - Εκδότης: HUTCH WHAMPOA FINANCE 14 - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-OCT-14 - 31-OCT-21 Επιτόκιο: 1.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ASTRAZENECA 0.875 24/11/2021	1.000,0000	98,38400000	98.384,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1143486865 - Εκδότης: ASTRAZENECA PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-NOV-14 - 24-NOV-21 Επιτόκιο: .875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
VESTAS WIND 11/3/2022	1.000,0000	96,06000000	96.060,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
KONINKLIJKE 15/3/2022	1.200,0000	90,34319421	108.411,83
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US500472AF27 - Εκδότης: KONINKLIJKE PHILIPS NV - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-MAR-12 - 15-MAR-22 Επιτόκιο: 3.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
BARCLAYS BANK 30/3/2022	1.000,0000	123,79100000	123.791,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0611398008 - Εκδότης: BARCLAYS BANK PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-MAR-11 - 30-MAR-22 Επιτόκιο: 6.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
SLB 2.4% 1/8/2022	1.240,0000	85,35704710	105.842,74
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: USL81445AD75 - Εκδότης: SCHLUMBERGER INVESTMENT - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JUL-12 - 01-AUG-22 Επιτόκιο: 2.4% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			

PEPSICO INC 1/3/2023	1.000,0000	87,59049066	87.590,49
- Isin: US713448CG16			
- Εκδότης: PEPSICO INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-FEB-13 - 01-MAR-23 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
MEX 2.75% 22/4/2023	3.000,0000	103,62100000	310.863,00
- Isin: XS0916766057			
- Εκδότης: UNITED MEXICAN STATES			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-13 - 22-APR-23 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SOCIETE AUTOROUTES 15/1/2025	1.000,0000	99,28500000	99.285,00
- Isin: FR0012300812			
- Εκδότης: SOCIETE DES AUTOROUTES			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-NOV-14 - 15-JAN-25 Επιτόκιο: 1.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EDEL FINANCE 27/1/2015	1.500,0000	96,87200000	145.308,00
- Isin: XS1176079843			
- Εκδότης: EDEL FINANCE INTL NV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-JAN-15 - 27-JAN-25 Επιτόκιο: 1.966%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CITIGROUP 28/1/2025	1.000,0000	96,53300000	96.533,00
- 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:			
REPUBLIC OF CHILE 30/1/2025	1.000,0000	98,09400000	98.094,00
- Isin: XS1151586945			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CHILE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-DEC-14 - 30-JAN-25 Επιτόκιο: 1.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SOCIETE GENERALE 27/2/2025	1.000,0000	93,33200000	93.332,00
- Isin: XS1195574881			
- Εκδότης: SOCIETE GENERALE SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-FEB-15 - 27-FEB-25 Επιτόκιο: 2.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLENCORE 1.75 17/3/2025	3.000,0000	91,09200000	273.276,00
- 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:			
BONOS 30/4/2025	1.000,0000	93,89500000	93.895,00
- Isin: ES00000126Z1			
- Εκδότης: BONOS Y OBLIG DEL ESTADO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-JAN-15 - 30-APR-25 Επιτόκιο: 1.6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			

OBRIGACOES DO TESOURO 15/04/2037	1.500,0000	105,37000000	158.055,00
- Isin: PTOTΕ50E0007			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-06 - 15-APR-37 Επιτόκιο: 4.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Βα1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SPGB 5.15 31/10/2044	1.000,0000	133,30200000	133.302,00
- Isin: ES00000124H4			
- Εκδότης: BONOS Y OBLIG DEL ESTADO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-OCT-13 - 31-OCT-44 Επιτόκιο: 5.15%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Βαα2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.432.205,04
ΣΥΝΟΛΟ II.2			4.432.205,04
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			4.493.344,80
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			6.748.929,46
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			22.003,11
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			6.770.932,57
III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EUR FX USD FUT SEP15	4,0000	1,11560000	498.525,34
EURO FX GBP CURR FUT sep15	4,0000	0,70945000	498.629,46
ΣΥΝΟΛΟ III.1			997.154,80
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			997.154,80
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			997.154,80

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