

**GMM ASPENDOS BALANCED FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017**

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN USD	179,6800	0,87627059	157,45
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			73.162,50
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			59.902,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>133.221,95</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 9.25 19/1/2027	1.000,0000	108,30100000	108.301,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS PCL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27		Επιτόκιο: 9.25%	
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG	
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>108.301,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>108.301,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>241.522,95</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	1.500,0000	27,22154255	40.832,31
- Isin: XS1136802615			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-NOV-14 - 19-JUN-18		Επιτόκιο: 10%	
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG	
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	40.000,0000	1,50366645	60.146,66
- Isin: XS1333828280			
- Εκδότης: INTL FINANCE CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-DEC-15 - 17-DEC-18		Επιτόκιο: 8.75%	
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG	
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	1.000,0000	91,92954784	91.929,55
- Isin: USG3925DAA84			
- Εκδότης: GERDAU TRADE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21		Επιτόκιο: 5.75%	
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG	
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GM 4.375 25/9/2021	840,0000	92,53066947	77.725,76
- Isin: US37045XAQ97			
- 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: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	1.000,0000	105,21600000	105.216,00
- Isin: XS1500377517			

- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-16 - 14-OCT-21	Επιτόκιο: 4.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>VALE BZ 4.375% 11/1/2022</b>	<b>800,0000</b>	<b>89,27882930</b>	<b>71.423,06</b>
- Isin: US919111TAM53			
- Εκδότης: VALE OVERSEAS LIMITED			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JAN-12 - 11-JAN-22	Επιτόκιο: 4.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>SYSTEMS SUNLIGHT ABEE 20/6/2022</b>	<b>360,0000</b>	<b>100,65000000</b>	<b>36.234,00</b>
- Isin: GRC8121176B9			
- Εκδότης: SYSTEMS SUNLIGHT ABEE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-17 - 20-JUN-22	Επιτόκιο: 4.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1%</b>	<b>390,0000</b>	<b>100,31000000</b>	<b>39.120,90</b>
- Isin: GRC3931176B0			
- Εκδότης: MYTILINEOS HOLDINGS S.A.			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-17 - 26-JUN-22	Επιτόκιο: 3.1%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>PETROBRAS ARGENTINA 21/7/2023</b>	<b>500,0000</b>	<b>92,44567122</b>	<b>46.222,84</b>
- Isin: USP7873PAE62			
- Εκδότης: PETROBRAS ARGENTINA SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUL-16 - 21-JUL-23	Επιτόκιο: 7.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ASSICURAZIONI GENERALI 4/5/2026</b>	<b>1.000,0000</b>	<b>108,23200000</b>	<b>108.232,00</b>
- Isin: XS1062900912			
- Εκδότης: ASSICURAZIONI GENERALI			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-MAY-14 - 04-MAY-26	Επιτόκιο: 4.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>OBRIGACOES DO TESOURO 14/04/2027</b>	<b>500,0000</b>	<b>109,19800000</b>	<b>54.599,00</b>
- Isin: PTOTEUOE0019			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-17 - 14-APR-27	Επιτόκιο: 4.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028</b>	<b>1.000,0000</b>	<b>109,66600000</b>	<b>109.666,00</b>
- Isin: XS1432493440			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JUN-16 - 14-JUN-28	Επιτόκιο: 3.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ECOPETROL SA 18/9/2043</b>	<b>500,0000</b>	<b>94,63634770</b>	<b>47.318,17</b>
- Isin: US279158AE95			
- Εκδότης: ECOPETROL SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-SEP-13 - 18-SEP-43	Επιτόκιο: 7.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>888.666,25</b>
<b>ZERO COUPON</b>			
<b>GTB 0 08/09/17</b>	<b>500,0000</b>	<b>99,57900000</b>	<b>49.789,50</b>
- Isin: GR0000167701			

- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUN-17 - 08-SEP-17			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON</b>			<b>49.789,50</b>
<b>STEPPED</b>			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	93,44900000	93.449,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27			Επιτόκιο: 5%
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
GGB 3% 24/2/27	800,0000	88,11500000	70.492,00
- Isin: GR0128014710			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-27			Επιτόκιο: 3%
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ STEPPED</b>			<b>163.941,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.1</b>			<b>1.102.396,75</b>
<b>2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ</b>			
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	1.000,0000	12,09253417	12.092,53
SBERBANK ADR	1.450,0000	9,06940063	13.150,63
ING GROUP NV	1.100,0000	15,10000000	16.610,00
PUBLIC POWER CORP.	7.600,0000	2,19000000	16.644,00
LANXESS AG	700,0000	66,29000000	46.403,00
LUKOIL PJSC-SPON ADR	400,0000	42,67437785	17.069,75
DEUTSCHE BANK AG	1.450,0000	15,52500000	22.511,25
POSCO -SPON ADR	690,0000	54,84577638	37.843,59
A.D.M.H.E. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε	7.600,0000	2,24000000	17.024,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>199.348,75</b>
<b>3. MARGIN</b>			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			8.144,09
MARGIN IN USD/BETA	38.653,8900	0,87627059	33.871,27
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>42.015,36</b>
<b>4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ</b>			
PROSHARES SHORT 7-10YR	2.300,0000	24,73273747	56.885,30
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.4</b>			<b>56.885,30</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)</b>			<b>1.400.646,16</b>

<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)</b>			<b>1.642.169,11</b>
<b>ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>75.580,14</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>1.717.749,25</b>

**IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ**

**1. FUTURES ON CURRENCY**

EURO FX USD CURR FUT SEP17	3,0000	1,14670000	376.807,31
----------------------------	--------	------------	------------

- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES

**ΣΥΝΟΛΟ IV.1**

**376.807,31**

**ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)**

**376.807,31**

**ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)**

**376.807,31**

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