

GMM ASPENDOS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN AUD	2.357,3400	0,68511921	1.615,06
CASH ACCOUNT IN CAD	2.294,9700	0,70482098	1.617,54
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			329.927,00
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			129.356,80
CASH ACCOUNT IN USD	2.901,1300	0,94867660	2.752,23
ΣΥΝΟΛΟ I.1			465.268,63
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	101,87450000	101.874,50
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	1.000,0000	105,69450000	105.694,50
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			207.569,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			207.569,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			672.837,63
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΔ			
FIXED			
KOMMUNIVEST I SVERIGE 13/2/2017	1.000,0000	94,93122095	94.931,22
- Isin: XS0745301258			
- Εκδότης: KOMMUNIVEST I SVERIGE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-FEB-12 - 13-FEB-17			Επιτόκιο: 1.625%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EXPORT CANADA 08/8/2017	980,0000	68,97437654	67.594,89
- Isin: AU3CB0197572			
- Εκδότης: EXPORT DEVELOPMNT CANADA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-AUG-12 - 08-AUG-17			Επιτόκιο: 3.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BAO TRANS ENTERPRISE	1.000,0000	100,97800000	100.978,00
- Isin: XS1181873776			
- Εκδότης: BAO-TRANS ENTERPRISE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-FEB-15 - 23-FEB-18			Επιτόκιο: 1.625%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			

ASTALDI SPA, 1/12/2020	1.000,0000	104,50000000	104.500,00
- Isin: XS1000393899			
- Εκδότης: ASTALDI SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-DEC-13 - 01-DEC-20 Επιτόκιο: 7.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GM 4.375 25/9/2021	840,0000	98,06944313	82.378,33
- 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: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	1.000,0000	99,56500000	99.565,00
- 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:			
TORONTO DOM 22/12/2021	600,0000	72,41119256	43.446,72
- Isin: CA8911452R48			
- Εκδότης: TORONTO-DOMINION BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-DEC-14 - 22-DEC-21 Επιτόκιο: 2.621%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALE BZ 4.375% 11/1/2022	800,0000	93,44464472	74.755,72
- Isin: US91911TAM53			
- Εκδότης: VALE OVERSEAS LIMITED			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JAN-12 - 11-JAN-22 Επιτόκιο: 4.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028	1.000,0000	102,01500000	102.015,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			770.164,88
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	88,27600000	88.276,00
- 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: B3e			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			88.276,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			858.440,88
2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
SBERBANK ADR	1.450,0000	10,98093160	15.922,35
NOVATEK OAO SPONS GDR	130,0000	123,13822218	16.007,97
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	1.000,0000	15,92828005	15.928,28
ΣΥΝΟΛΟ II.2			47.858,60

3. MARGIN

MARGIN IN USD/BETA	12.329,0000	0,94867660	11.696,23
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			23,10
ΣΥΝΟΛΟ II.3			11.719,33

4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

PROSHARES SHORT 7-10YR	2.300,0000	27,57793378	63.429,25
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	3.550,0000	16,81000000	59.675,50
ΣΥΝΟΛΟ II.4			123.104,75

ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)

1.041.123,56

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

1.713.961,19

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

8.409,56

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

1.722.370,75

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

0,00

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