

**GMM ASPENDOS BALANCED FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017**

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN RUB	3.482,3700	0,01658017	57,74
CASH ACCOUNT IN USD	1.729,0500	0,93536620	1.617,29
CASH ACCOUNT IN NOK	262,0000	0,10907147	28,58
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			149.842,21
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			59.904,50
CASH ACCOUNT IN AUD	3.149,3500	0,71520526	2.252,43
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>213.702,75</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	104,66650000	104.666,50
- 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	500,0000	107,21950000	53.609,75
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>158.276,25</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>158.276,25</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>371.979,00</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΓΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
EXPORT CANADA 08/8/2017	980,0000	71,84451438	70.407,62
- 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 ENTERPRICE	1.000,0000	100,99700000	100.997,00
- 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:			
INTL FINANCE 17/12/2018	40.000,0000	1,68353423	67.341,37
- 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:			
<b>ASTALDI SPA, 1/12/2020</b>	<b>1.000,0000</b>	<b>105,00000000</b>	<b>105.000,00</b>
- 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:			
<b>GERDAU TRADE 30/1/2021</b>	<b>1.000,0000</b>	<b>98,21345057</b>	<b>98.213,45</b>
- 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:			
<b>GM 4.375 25/9/2021</b>	<b>840,0000</b>	<b>98,41548966</b>	<b>82.669,01</b>
- 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:			
<b>HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21</b>	<b>1.000,0000</b>	<b>100,51900000</b>	<b>100.519,00</b>
- 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>TORONTO DOM 22/12/2021</b>	<b>600,0000</b>	<b>72,48650543</b>	<b>43.491,90</b>
- 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:			
<b>VALE BZ 4.375% 11/1/2022</b>	<b>800,0000</b>	<b>95,05658965</b>	<b>76.045,27</b>
- 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: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>OPAP 21/3/2022</b>	<b>600,0000</b>	<b>100,66000000</b>	<b>60.396,00</b>
- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22	Επιτόκιο: 3.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028</b>	<b>1.000,0000</b>	<b>107,01400000</b>	<b>107.014,00</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>100,07950613</b>	<b>50.039,75</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:

**ΣΥΝΟΛΟ FIXED**

**962.134,37**

**STEPPED**

REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027

1.000,0000

93,50000000

93.500,00

- 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

**ΣΥΝΟΛΟ STEPPED**

**93.500,00**

**ΣΥΝΟΛΟ II.1**

**1.055.634,37**

**2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ**

MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	1.000,0000	14,70395660	14.703,96
SBERBANK ADR	1.450,0000	10,79412590	15.651,48
LANXESS AG	700,0000	62,89000000	44.023,00
NATIXIS	5.400,0000	5,77600000	31.190,40
POSCO -SPON ADR	690,0000	60,33111963	41.628,47
LUKOIL PJSC-SPON ADR	400,0000	49,53699373	19.814,80
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>167.012,11</b>
<b>3. MARGIN</b>			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			158,23
MARGIN IN USD/BETA	14.218,7500	0,93536620	13.299,74
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>13.457,97</b>
<b>4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ</b>			
PROSHARES SHORT 7-10YR	2.300,0000	26,73276588	61.485,36
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	3.550,0000	15,94500000	56.604,75
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.4</b>			<b>118.090,11</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)</b>			<b>1.354.194,56</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)</b>			
			<b>1.726.173,56</b>
<b>ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			
			<b>11.205,60</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>1.737.379,16</b>
<b>IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. FUTURES ON CURRENCY</b>			
EUR FX USD FUT JUN17	3,0000	1,07220000	376.087,36
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
<b>ΣΥΝΟΛΟ IV.1</b>			<b>376.087,36</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)</b>			<b>376.087,36</b>
<b>ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)</b>			<b>376.087,36</b>

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