

GMM BEST SELECTION BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	27.000,0000	0,10751763	2.902,98
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			63.373,25
CASH ACCOUNT IN GBP	9.513,1500	1,20992136	11.510,16
CASH ACCOUNT IN USD	4.917,5000	0,90073861	4.429,38
ΣΥΝΟΛΟ I.1			82.215,77
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	1.100,0000	106,55650000	117.212,15
- 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	1.500,0000	102,61250000	153.918,75
- 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:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.000,0000	103,49450000	206.989,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			478.119,90
ΣΥΝΟΛΟ I.2			478.119,90
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			560.335,67
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	2.100,0000	100,00000000	210.000,00
- 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:			
BAO TRANS ENTERPRICE	1.000,0000	100,02600000	100.026,00
- 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:			
FRIGOGLASS 8,25% 15/05/2018	1.000,0000	60,25000000	60.250,00
- Isin: XS0932291007			
- Εκδότης: FRIGOGLASS FINANCE BV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-13 - 15-MAY-18	Επιτόκιο: 8.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC+			
- Πρόσθετοι Όροι:			

PFOURS 5.25 1/2/2019	1.000,0000	102,12500000	102.125,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0982710153 - Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-FEB-19 Επιτόκιο: 5.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
PPC FINANCE 1/5/2019	1.000,0000	79,74100000	79.741,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1063837741 - Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19 Επιτόκιο: 5.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC- - Πρόσθετοι Όροι: 			
VALLOUREC SA 2/8/2019	1.000,0000	89,75000000	89.750,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: FR0011302793 - Εκδότης: VALLOUREC SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-AUG-12 - 02-AUG-19 Επιτόκιο: 3.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB- - Πρόσθετοι Όροι: 			
SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019	1.000,0000	105,12500000	105.125,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1082459568 - Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 15-NOV-19 Επιτόκιο: 3.3524% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.500,0000	100,69200000	151.038,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1327539976 - Εκδότης: OTE PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-15 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: 4.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GAZPROM 3.6% 26/02/2021	1.200,0000	103,50000000	124.200,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1038646078 - Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA) - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-FEB-14 - 26-FEB-21 Επιτόκιο: 3.6% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GM 4.375 25/9/2021	2.000,0000	94,91533057	189.830,66
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US37045XAAQ97 - 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: 			
BRF 3/6/2022	1.000,0000	98,05000000	98.050,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1242327168 - Εκδότης: BRF SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-15 - 03-JUN-22 Επιτόκιο: 2.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
EMPRESA 5.15 15/06/2022	1.400,0000	92,28607458	129.200,50
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US29082AAA51 - Εκδότης: EMPRESA BRAS DE AERONAU - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUN-12 - 15-JUN-22 Επιτόκιο: 5.15% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			

MMC NORLISK NICKEL 14/10/2022	2.000,0000	99,86939290	199.738,79
- Isin: XS1298447019			
- Εκδότης: MMC NORILSK NICK VIA MMC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-15 - 14-OCT-22 Επιτόκιο: 6.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
RZD CAPITAL 4.6% 06/03/2023	1.200,0000	107,15300000	128.583,60
- Isin: XS1041815116			
- Εκδότης: RZD CAPITAL PLC (RZD)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAR-14 - 06-MAR-23 Επιτόκιο: 4.6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	13.500,0000	11,62459143	156.931,98
- Isin: NO0010646813			
- Εκδότης: NORWEGIAN KINGOM			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-MAY-12 - 24-MAY-23 Επιτόκιο: 2%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VMED 15/1/2025	1.000,0000	96,50000000	96.500,00
- Isin: XS1169920193			
- Εκδότης: VIRGIN MEDIA FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 15-JAN-25 Επιτόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ECOPETROL SA 18/9/2043	300,0000	89,36317781	26.808,95
- 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			2.047.899,48
STEPPED			
GGB 3% 24/2/24	1.380,0000	72,41600000	99.934,08
- Isin: GR0128011682			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-24 Επιτόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			99.934,08
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.147.833,56
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	90,74410163	191.016,33
- Isin: GB00BHHXPS12			
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			191.016,33
ΣΥΝΟΛΟ II.2			191.016,33
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
TERNA ENERGY SA	5.600,0000	2,41000000	13.496,00
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	4.000,0000	6,22000000	24.880,00
HELLENIC TELECOM ORG	7.000,0000	8,07000000	56.490,00
EUROBANK	88.500,0000	0,55000000	48.675,00
MYTILINEOS HOLDINGS S.A.	9.000,0000	3,77000000	33.930,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			177.471,00

4. ΜΕΤΟΧΕΣ ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLOBO PLC -GBO LN	380.000,0000	0,01209921	4.597,70
ΣΥΝΟΛΟ II.4			4.597,70
5. MARGIN			
MARGIN ΒΕΤΑ SEC IN EURO / EUREX			1.379,83
MARGIN IN GBP/ΒΕΤΑ	14.412,5000	1,20992136	17.437,99
ΣΥΝΟΛΟ II.5			18.817,82
6. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
DBX STX EUROPE BANKS SHORT	3.900,0000	25,38000000	98.982,00
I PATH DJ -UBS AGR SUBINDX	25,0000	35,56197082	889,05
ΣΥΝΟΛΟ II.6			99.871,05
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			2.639.607,46
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			3.199.943,13
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			51.815,81
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			3.251.758,94
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EURO FX GBP CURR sep16	2,0000	0,83845000	253.614,64
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE			
- Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			253.614,64
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			253.614,64
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			253.614,64

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