

GMM BEST SELECTION BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	27.000,0000	0,11127803	3.004,51
CASH ACCOUNT IN GBP	11.757,9800	1,16139972	13.655,71
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			304.626,98
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			449.970,00
CASH ACCOUNT IN USD	270.606,1900	0,89597706	242.456,94
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.013.714,14
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 06/5/2022	1.500,0000	104,31350000	156.470,25
- 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:			
CYPRUS 3.75 26/7/2023	700,0000	103,16950000	72.218,65
- Isin: XS1457553367			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUL-16 - 26-JUL-23			Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.000,0000	106,45650000	212.913,00
- 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			441.601,90
ΣΥΝΟΛΟ I.2			441.601,90
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			1.455.316,04
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	2.100,0000	100,00000000	210.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17			Επιτόκιο: 6%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BAO TRANS ENTERPRICE	1.000,0000	101,04500000	101.045,00
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	1.000,0000	102,37500000	102.375,00
- 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	82,19800000	82.198,00
- 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:			
SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019	1.000,0000	105,12500000	105.125,00
- 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	103,32000000	154.980,00
- 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:			
GM 4.375 25/9/2021	2.000,0000	95,42155721	190.843,11
- 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:			
EMPRESA 5.15 15/06/2022	1.400,0000	95,04435086	133.062,09
- 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:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	13.500,0000	11,82685139	159.662,49
- 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	99,00000000	99.000,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			1.338.290,69
STEPPED			
GGB 3% 24/2/24	1.380,0000	73,09700000	100.873,86
- 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			100.873,86
ΣΥΝΟΛΟ II.1			1.439.164,55

2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

FIXED

GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	58,06998595	122.237,32
- Isin: GB00BBHXP512			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18			Επιτόκιο: 9%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			122.237,32

ΣΥΝΟΛΟ II.2

122.237,32

3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ

TERNA ENERGY SA	5.600,0000	2,58000000	14.448,00
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	4.000,0000	7,52000000	30.080,00
HELLENIC TELECOM ORG	7.000,0000	7,80000000	54.600,00
EUROBANK	88.500,0000	0,50800000	44.958,00
ΜΥΤΙΛΙΝΕΟΣ HOLDINGS S.A.	9.000,0000	4,16000000	37.440,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			181.526,00

4. MARGIN

MARGIN IN GBP/BETA	30.607,5000	1,16139972	35.547,54
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			1.362,88
ΣΥΝΟΛΟ II.4			36.910,42

5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

I PATH DJ -UBS AGR SUBINDX	25,0000	31,99104023	799,78
ΣΥΝΟΛΟ II.5			799,78
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.780.638,07

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

3.235.954,11

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

31.127,40

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

3.267.081,51

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES ON CURRENCY

EURO FX GBP CURR FUT DEC16	1,0000	0,86765000	125.961,06
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE			Χώρα: UNITED STATES

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

125.961,06

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

125.961,06

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

125.961,06

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