

GMM DEVELOPED MARKETS BALANCED USD FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	48,5500	0,11923145	5,79
CASH ACCOUNT IN DKK	740,2200	0,15345723	113,59
CASH ACCOUNT IN GBP	128,7200	1,29780628	167,05
EUROBANK CASH IN USD			106.478,56
CASH ACCOUNT IN EUR	35.000,0000	1,14120000	39.942,00
NATIONAL BANK OF GREECE CASH IN USD			1,56
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) IN EUR	8.001,5100	1,14120000	9.131,32
ΣΥΝΟΛΟ I.1			155.839,87
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			155.839,87
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EUROPEAN INV 21-12/2017	1.500,0000	30,58142840	45.872,14
- Isin: XS1014703851			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JAN-14 - 21-DEC-17 Επιτόκιο: 10.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EMC 1/6/2018	300,0000	99,44600000	29.833,80
- Isin: US268648AP77			
- Εκδότης: EMC CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-JUN-13 - 01-JUN-18 Επιτόκιο: 1.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
APPLE 7/2/2020	500,0000	99,47100000	49.735,50
- Isin: US037833AX89			
- Εκδότης: APPLE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-FEB-15 - 07-FEB-20 Επιτόκιο: 1.55%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALE BZ 4.375% 11/1/2022	300,0000	101,88500000	30.565,50
- 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:			
GASLOG 8.875 22/3/2022	200,0000	105,61000000	21.122,00
- Isin: USG37585AC37			
- Εκδότης: GASLOG LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-17 - 22-MAR-22 Επιτόκιο: 8.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1%	200,0000	114,47377200	22.894,75
- Isin: GRC3931176B0			
- Εκδότης: ΜΥΤΙΛΙΝΕΟΣ 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:			
REPUBLIC OF PORTUGAL 15/10/2024	500,0000	102,07600000	51.038,00

- Isin: XS1085735899			
- Εκδότης: REPUBLIC OF PORTUGAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-JUL-14 - 15-OCT-24	Επιτόκιο: 5.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			251.061,69
FLOATING			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	400,0000	107,88500000	43.154,00
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.8781%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			43.154,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			294.215,69
2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
PUBLIC POWER CORP.	4.000,0000	2,49922800	9.996,91
A.D.M.H.E. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε	4.000,0000	2,55628800	10.225,15
BANK OF AMERICA COPR	1.000,0000	26,70000000	26.700,00
AGNC INVESTMENT	1.000,0000	21,29000000	21.290,00
ANNALY CAPITAL MANAGMENT	2.000,0000	12,05000000	24.100,00
HELLENIC TELECOM ORG	1.000,0000	12,02824800	12.028,25
ΣΥΝΟΛΟ II.2			104.340,31
3. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA			7.319,15
MARGIN IN EUR/BETA	9.379,8300	1,14120000	10.704,26
ΣΥΝΟΛΟ II.3			18.023,41
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			

ISHARES US PREFERRED STOCK E	1.400,0000	39,17000000	54.838,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			54.838,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			471.417,41
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			627.257,28
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-31.683,01
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			595.574,27
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			0,00

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