

GMM DEVELOPED MARKETS BALANCED USD 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 DKK	740,2200	0,14978594	110,87
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) IN EUR	40.995,0000	1,11610000	45.754,52
EUROBANK CASH IN USD			302.732,96
NATIONAL BANK OF GREECE CASH IN USD			70.000,00
CASH ACCOUNT IN EUR	112.692,3900	1,11610000	125.775,98
ΣΥΝΟΛΟ I.1			544.374,33
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 06/5/2022	1.000,0000	116,42429735	116.424,30
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			116.424,30
ΣΥΝΟΛΟ I.2			116.424,30
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			660.798,63
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
KOMMUNIVEST I SVERIGE 13/2/2017	500,0000	100,27800000	50.139,00
- 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:			
THYSSENKRUP 28/02/17 4.375	500,0000	113,42254640	56.711,27
- Isin: DE000A1MA9H4			
- Εκδότης: THYSSENKRUPP AG			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-FEB-12 - 28-FEB-17 Επιτόκιο: 4.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EUROPEAN INVNT 0.875% 18/4/2017	1.000,0000	100,02900000	100.029,00
- Isin: US298785GK68			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-MAR-14 - 18-APR-17 Επιτόκιο: .875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: AAA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLENCORE CANADA 15/9/2017	300,0000	102,28400000	30.685,20
- Isin: US655422AU70			
- Εκδότης: GLENCORE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUN-05 - 15-JUN-17 Επιτόκιο: 5.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			

EMC 1/6/2018	300,0000	98,12500000	29.437,50
- Isin: US268648AP77			
- Εκδότης: EMC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-JUN-13 - 01-JUN-18	Επιτόκιο: 1.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			267.001,97
ΣΥΝΟΛΟ II.1			267.001,97
2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
BANK OF AMERICA COPR	500,0000	26,26000000	13.130,00
ΣΥΝΟΛΟ II.2			13.130,00
3. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA			7.319,15
MARGIN IN EUR/BETA	9.379,8300	1,11610000	10.468,83
ΣΥΝΟΛΟ II.3			17.787,98
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES ULTR. S&P 500	1.000,0000	16,39000000	16.390,00
ETF SHORTDAX X2 DAILY 1C	2.000,0000	6,57940950	13.158,82
ΣΥΝΟΛΟ II.4			29.548,82
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			327.468,77
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			988.267,40
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-371.062,02
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			617.205,38
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			0,00

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