

**GMM DEVELOPMENT BALANCED FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017**

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN USD	191,1400	0,87627059	167,49
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			14.966,61
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			1.235,73
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>16.369,83</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.500,0000	109,39450000	164.091,75
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>164.091,75</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>164.091,75</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>180.461,58</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	2.000,0000	27,22154255	54.443,09
- Isin: XS1136802615			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-NOV-14 - 19-JUN-18		Επιτόκιο: 10%	
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG	
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	60.000,0000	1,50366645	90.219,99
- 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:			
NORWEGIAN GOV 22/5/2019	4.300,0000	11,20965804	48.201,53
- Isin: NO0010429913			
- Εκδότης: NORWEGIAN GOVERNMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-08 - 22-MAY-19		Επιτόκιο: 4.5%	
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG	
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	1.500,0000	100,00000000	150.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-20		Επιτόκιο: 6%	
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed		Πηγή: BLOOMBERG	
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	1.000,0000	91,92954784	91.929,55
- 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:			

REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	93,73817035	140.607,26
- Isin: US040114GW47			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-16 - 22-APR-21 Επικόκιο: 6.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000	106,00600000	106.006,00
- Isin: XS1405774727			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-SEP-16 - 15-SEP-21 Επικόκιο: 6.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	1.000,0000	105,21600000	105.216,00
- Isin: XS1500377517			
- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-16 - 14-OCT-21 Επικόκιο: 4.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1%	80,0000	100,31000000	8.024,80
- Isin: GRC3931176B0			
- Εκδότης: MYTILINEOS HOLDINGS S.A.			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-17 - 26-JUN-22 Επικόκιο: 3.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS ARGENTINA 21/7/2023	300,0000	92,44567122	27.733,70
- Isin: USP7873PAE62			
- Εκδότης: PETROBRAS ARGENTINA SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUL-16 - 21-JUL-23 Επικόκιο: 7.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>822.381,92</b>

**FLOATING**

GOLDMAN SACHS 15/11/2021	500,0000	88,42271293	44.211,36
- Isin: US38145GAF72			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21 Επιδόκιο: 2.3518%			
- Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			

**ΣΥΝΟΛΟ FLOATING**

**44.211,36**

**ΣΥΝΟΛΟ II.1**

**866.593,28**

**2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ**

<b>FIXED</b>			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	3.314,8621	46,62000000	154.538,87
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιδόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CELTONA LTD 15/12/2019	78,0000	100,00000000	7.800,00
- Isin:			
- Εκδότης: CELTONA LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-16 - 15-DEC-19 Επιδόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			

**ΣΥΝΟΛΟ FIXED**

**162.338,87**

**ΣΥΝΟΛΟ II.2**

**162.338,87**

**3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ**

QUALITY & RELIABILITY SA	67.439,0000	0,19000000	12.813,41
LUKOIL PJSC-SPON ADR	400,0000	42,67437785	17.069,75
MYTILINEOS HOLDINGS S.A.	4.600,0000	8,26000000	37.996,00
DEUTSCHE BANK AG	1.450,0000	15,52500000	22.511,25
LANXESS AG	530,0000	66,29000000	35.133,70
ING GROUP NV	1.300,0000	15,10000000	19.630,00

**ΣΥΝΟΛΟ II.3**

**145.154,11**

**4. MARGIN**

MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			26.121,30
MARGIN IN USD/BETA	27.513,0500	0,87627059	24.108,88

**ΣΥΝΟΛΟ II.4**

**50.230,18**

**5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ**

PROSHARES SHORT 7-10YR	2.230,0000	24,73273747	55.154,00
------------------------	------------	-------------	-----------

**ΣΥΝΟΛΟ II.5**

**55.154,00**

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)**

**1.279.470,44**

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)**

**1.459.932,02**

**ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ**

**124.767,82**

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

**1.584.699,84**

**IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ**

**1. FUTURES ON CURRENCY**

EURO FX USD CURR FUT SEP17	3,0000	1,14670000	376.807,31
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			

**ΣΥΝΟΛΟ IV.1**

**376.807,31**

**ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)**

**376.807,31**

**ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)**

**376.807,31**

GMM GLOBAL MONEY MANAGERS LTD

Στασίνου 36, 2003 Λευκωσία, Κύπρος