

GMM DEVELOPMENT 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 ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	54.390,3000	0,10751763	5.847,92
CASH ACCOUNT IN GBP	11.953,0400	1,20992136	14.462,24
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			575.607,96
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			300.151,99
CASH ACCOUNT IN USD	4.699,2100	0,90073861	4.232,76
ΣΥΝΟΛΟ I.1			900.302,87
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	620,0000	99,71050000	61.820,51
- Isin: CY0146220815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18 Επιτόκιο: 2%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	1.000,0000	106,55650000	106.556,50
- 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	2.000,0000	102,61250000	205.225,00
- 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 3.25 18/1/2023	1.500,0000	99,39500000	149.092,50
- 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: 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			729.683,51
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 5/8/2016	2.000,0000	99,75200000	199.504,00
- Isin: CY0146480815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-16 - 05-AUG-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			

CYPRUS TBILL 2/9/2016	3.000,0000	99,50900000	298.527,00
- Isin: CY0146530817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-16 - 02-SEP-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			498.031,00
ΣΥΝΟΛΟ Ι.2			1.227.714,51
3. ΛΟΙΠΟΙ ΟΡΓΑΝΙΣΜΟΙ ΣΥΛΛΟΓΙΚΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ			
GMM MARATHON ASSETS CYPRUS BOND FUND	5.280,4270	9,26240000	48.909,43
ΣΥΝΟΛΟ Ι.3			48.909,43
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.176.926,81
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	2.000,0000	100,02600000	200.052,00
- 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:			
IRISH 4.5% 18/10/2018	1.800,0000	111,16000000	200.088,00
- Isin: IE00B28HXX02			
- Εκδότης: IRISH TSY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-OCT-07 - 18-OCT-18			Επιτόκιο: 4.5%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	2.000,0000	102,12500000	204.250,00
- 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:			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.000,0000	100,69200000	100.692,00
- 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:			
ANADARKO PETR. 15/3/2021	1.000,0000	95,47739146	95.477,39
- Isin: US032511BM81			
- Εκδότης: ANADARKO PETROLEUM CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-16 - 15-MAR-21			Επιτόκιο: 4.85%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022	9.000,0000	11,01432135	99.128,89
- Isin: XS1227593933			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-MAY-15 - 12-MAY-22			Επιτόκιο: 1.5%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			

ABXCN 4.1% 1/5/2023	1.000,0000	95,15402630	95.154,03
- Isin: US067901AQ17			
- Εκδότης: BARRICK GOLD CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-SEP-13 - 01-MAY-23	Επιτόκιο: 4.1%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	19.600,0000	11,62459143	227.841,99
- 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:			
ENDESA 15/4/2024	1.200,0000	95,67735543	114.812,83
- Isin: US29246RAA14			
- Εκδότης: EMPRESA NACIONAL DE ELEC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-APR-14 - 15-APR-24	Επιτόκιο: 4.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			1.547.497,13
ΣΥΝΟΛΟ II.1			1.547.497,13
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.631,2500	90,74410163	238.770,42
- Isin: GB00BBHXPS12			
- 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			238.770,42
ΣΥΝΟΛΟ II.2			238.770,42
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
SILVER WHEATON CORP	5.200,0000	21,19437939	110.210,77
ΣΥΝΟΛΟ II.3			110.210,77
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			897,97
MARGIN IN GBP/BETA	14.412,5000	1,20992136	17.437,99
ΣΥΝΟΛΟ II.4			18.335,96
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ISHARES SILVER TRUST	6.500,0000	16,09169519	104.596,02
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	2.900,0000	51,30000000	148.770,00
DBX STX EUROPE BANKS SHORT	4.800,0000	25,38000000	121.824,00
ΣΥΝΟΛΟ II.5			375.190,02
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			2.290.004,30
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			4.466.931,11
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			38.696,86
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			4.505.627,97
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