

GMM DEVELOPMENT 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 ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN AUD	193,3900	0,68226786	131,94
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			313.782,95
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			660.021,99
CASH ACCOUNT IN GBP	14.759,0700	1,16139972	17.141,18
ΣΥΝΟΛΟ I.1			991.078,06
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	620,0000	100,80850000	62.501,27
- 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 3.25 18/1/2023	1.500,0000	101,92600000	152.889,00
- 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:			
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			500.521,92
ΣΥΝΟΛΟ I.2			500.521,92
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			1.491.599,98
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- 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	2.000,0000	101,04500000	202.090,00
- 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	2.000,0000	102,37500000	204.750,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
PIRELLI INT 18/11/2019	1.000,0000	100,82800000	100.828,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1139287350 - Εκδότης: PIRELLI INTERNATIONAL - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-NOV-14 - 18-NOV-19 Επιτόκιο: 1.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA - Πρόσθετοι Όροι: 			
ANADARKO PETR. 15/3/2021	1.000,0000	96,44117911	96.441,18
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	97,57279814	146.359,20
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: USP04808AA23 - Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-16 - 22-APR-21 Επιτόκιο: 6.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
REPUBLIC OF INDONESIA 8/7/2021	1.000,0000	106,86800000	106.868,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1084368593 - Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUL-14 - 08-JUL-21 Επιτόκιο: 2.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000	100,12900000	100.129,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1405774727 - Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-SEP-16 - 15-SEP-21 Επιτόκιο: 6.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022	9.000,0000	11,28092138	101.528,29
<ul style="list-style-type: none"> - 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	96,65800556	96.658,01
<ul style="list-style-type: none"> - 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	9.800,0000	11,82685139	115.903,14
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			

AUSTRALIAN GOVERNMENT 21/4/2024	3.000,0000	72,40226513	217.206,80
- Isin: AU3TB0000143			
- Εκδότης: AUSTRALIAN GOVERNMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-APR-12 - 21-APR-24	Επιτόκιο: 2.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
KINDER MORGAN/DELAWA 16/3/2027	1.000,0000	100,95100000	100.951,00
- Isin: XS1196817586			
- Εκδότης: KINDER MORGAN INC /DELAWA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-MAR-15 - 16-MAR-27	Επιτόκιο: 2.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή:		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			1.799.712,62
ΣΥΝΟΛΟ II.1			1.799.712,62
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.631,2500	58,06998595	152.796,65
- 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			152.796,65
ΣΥΝΟΛΟ II.2			152.796,65
3. MARGIN			
MARGIN IN GBP/BETA	30.607,5000	1,16139972	35.547,54
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			42,34
ΣΥΝΟΛΟ II.3			35.589,88
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ETFS PRECIOUS METALS	2.400,0000	16,23500000	38.964,00
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	4.450,0000	49,22000000	219.029,00
ISHARES EM ASIA MLCL GOV BND	1.160,0000	85,84000000	99.574,40
ΣΥΝΟΛΟ II.4			357.567,40
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			2.345.666,55
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			3.837.266,53
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			39.224,03
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			3.876.490,56
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
2. OPTIONS ON STOCKS			
OPTION DAX 12/16/16	40,0000	13,90000000	2.780,00
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT	Χώρα: GERMANY		
ΣΥΝΟΛΟ IV.2			2.780,00
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			128.741,06
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			128.741,06

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