

GMM DEVELOPMENT BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	963,6200	0,10621913	102,35
CASH ACCOUNT IN GBP	11.953,0400	1,26334407	15.100,80
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			762.674,06
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			300.151,99
CASH ACCOUNT IN USD	64.750,9700	0,87834870	56.873,93
ΣΥΝΟΛΟ 1.1			1.134.903,13
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	620,0000	98,45500000	61.042,10
- 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	105,70400000	105.704,00
- 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	102,42250000	204.845,00
- 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	97,78200000	146.673,00
- 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:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.500,0000	103,21850000	258.046,25
- 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			776.310,35
ΣΥΝΟΛΟ 1.2			776.310,35
3. ΛΟΙΠΟΙ ΟΡΓΑΝΙΣΜΟΙ ΣΥΛΛΟΓΙΚΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ			
GMM MARATHON ASSETS CYPRUS BOND FUND	5.280,4270	9,08920000	47.994,86
ΣΥΝΟΛΟ 1.3			47.994,86
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			1.959.208,34

II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ

FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	2.100,0000	100,00000000	210.000,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
IRISH 4.5% 18/10/2018	1.800,0000	112,17800000	201.920,40
<ul style="list-style-type: none"> - 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: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
PFOURS 5.25 1/2/2019	2.000,0000	102,50000000	205.000,00
<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: 			
HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19	1.000,0000	87,89500000	87.895,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1083287547 - Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JUL-14 - 04-JUL-19 Επιτόκιο: 5.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A - Πρόσθετοι Όροι: 			
VALLOUREC SA 2/8/2019	1.000,0000	85,25000000	85.250,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: FR0011302793 - Εκδότης: VALLOUREC SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-AUG-12 - 02-AUG-19 Επιτόκιο: 3.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB- - Πρόσθετοι Όροι: 			
SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019	1.000,0000	100,25000000	100.250,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1082459568 - Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 15-NOV-19 Επιτόκιο: 3.3524% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.000,0000	99,38700000	99.387,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
GAZPROM 3.389% 20/03/2020	1.000,0000	99,87500000	99.875,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0906946008 - Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA) - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-13 - 20-MAR-20 Επιτόκιο: 3.389% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			

ΟΙ EUROPEAN GROUP BV - Isin: XS0908230781 - Εκδότης: ΟΙ EUROPEAN GROUP BV - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-13 - 31-MAR-21 Επιτόκιο: 4.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3 - Πρόσθετοι Όροι:	1.000,0000	109,25000000	109.250,00
VESTAS WIND 11/3/2022 - Isin: XS1197336263 - Εκδότης: VESTAS WIND SYSTEMS A/S - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-MAR-15 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 2.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA - Πρόσθετοι Όροι:	1.500,0000	101,09800000	151.647,00
BRF 3/6/2022 - Isin: XS1242327168 - Εκδότης: BRF SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-15 - 03-JUN-22 Επιτόκιο: 2.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι:	1.000,0000	92,59700000	92.597,00
CARNIVAL CORP 7/11/2022 - Isin: XS1317305198 - Εκδότης: CARNIVAL CORP - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-NOV-15 - 07-NOV-22 Επιτόκιο: 1.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι:	1.000,0000	102,40800000	102.408,00
NORWEGIAN GOV 24/5/2023 - 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:	19.600,0000	11,43693239	224.163,87
ENDESA 15/4/2024 - 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:	1.200,0000	91,23583663	109.483,00
FERROVIAL EM. 15/7/2024 - Isin: ES0205032008 - Εκδότης: FERROVIAL SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-24 Επιτόκιο: 2.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB - Πρόσθετοι Όροι:	1.000,0000	107,58000000	107.580,00
CITIGROUP 28/1/2025 - Isin: XS1173792059 - Εκδότης: CITIGROUP INC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 28-JAN-25 Επιτόκιο: 1.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A - Πρόσθετοι Όροι:	1.500,0000	101,50600000	152.259,00
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			2.138.965,27
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.138.965,27

2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.631,2500	75,80064431	199.450,45
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			199.450,45
ΣΥΝΟΛΟ II.2			199.450,45
3. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			8.649,41
MARGIN IN USD/BETA	18.571,5300	0,87834870	16.312,28
ΣΥΝΟΛΟ II.3			24.961,69
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
DBX STX EUROPE BANKS SHORT	4.300,0000	23,92000000	102.856,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			102.856,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			2.466.233,41
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			4.425.441,75
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			42.793,37
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			4.468.235,12

III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EURO FX USD CURR FUT jun16	2,0000	1,14120000	250.592,89
ΣΥΝΟΛΟ III.1			250.592,89
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			250.592,89
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			250.592,89

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