

GMM GERAISTOS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN GBP	19.285,0800	1,13722948	21.931,56
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.373,69
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			565,73
CASH ACCOUNT IN USD	35.027,8100	0,87627059	30.693,84
ΣΥΝΟΛΟ I.1			54.564,82
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΓΑ			
FIXED			
INTL FINANCE 17/12/2018	12.000,0000	1,50366645	18.044,00
- 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:			
PPC FINANCE 1/5/2019	1.000,0000	87,39400000	87.394,00
- Isin: XS1063837741			
- Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19 Επιτόκιο: 5.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FORD MOTOER 2/6/2020	1.300,0000	68,04592283	88.459,70
- Isin: XS1423777561			
- Εκδότης: FORD MOTOR CREDIT CO LLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-JUN-16 - 02-JUN-20 Επιτόκιο: 3.588%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	250,0000	100,00000000	25.000,00
- 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:			
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 Επιτόκιο: 6.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- 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 Επιτόκιο: 4.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ECOPETROL SA 18/9/2043	570,0000	94,63634770	53.942,72
- Isin: US279158AE95			
- Εκδότης: ECOPETROL SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-SEP-13 - 18-SEP-43 Επιτόκιο: 7.375%			

- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			518.663,68
STEPPED			
GGB 3% 24/2/26	1.000,0000	89,32100000	89.321,00
- Isin: GR0128013704			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-26	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			89.321,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			607.984,68
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	662,9724	46,62000000	30.907,77
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CELTONA LTD 15/12/2019	66,0000	100,00000000	6.600,00
- Isin:			
- Εκδότης: CELTONA LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-16 - 15-DEC-19	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή:		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			37.507,77
ΣΥΝΟΛΟ II.2			37.507,77
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
QUALITY & RELIABILITY SA	13.488,0000	0,19000000	2.562,72
EUROBANK	94.421,0000	0,98000000	92.532,58
NOVATEK OAO SPONS GDR	120,0000	97,61654399	11.713,99
NAVIOS MARITIME HOLDINGS	9.930,0000	1,20049071	11.920,87
DIANA SHPPING	4.600,0000	3,55765860	16.365,23
PIRAEUS PORT AUTHORITY SA	1.100,0000	15,43000000	16.973,00
MOTOROIL	1.000,0000	19,07000000	19.070,00
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	2.020,0000	9,90000000	19.998,00
PUBLIC POWER CORP.	9.330,0000	2,19000000	20.432,70
GEK GROUP OF COMPANIES S.A.	5.000,0000	4,06000000	20.300,00
POTASH CORP	1.450,0000	14,30503889	20.742,31
A.D.M.H.E. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε	9.330,0000	2,24000000	20.899,20
LUKOIL PJSC-SPON ADR	520,0000	42,67437785	22.190,68
ΤΡΑΠΕΖΑ ALPHA BANK	10.500,0000	2,16000000	22.680,00
TERNA ENERGY SA	5.950,0000	3,99000000	23.740,50
VALLOUREC SA	4.730,0000	5,31900000	25.158,87
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	2.530,0000	12,09253417	30.594,11
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	37.000,0000	0,21500000	7.955,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			405.829,76
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			9.194,58
ΣΥΝΟΛΟ II.4			9.194,58
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES ULTRA BLOOM. CR	935,0000	13,02138100	12.174,99
GLOBAL X COPPER MINERS ETF	800,0000	18,38415703	14.707,33
PROSHARES SHORT MSCI EMR MKT	1.800,0000	18,26147914	32.870,66
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	1.180,0000	13,99000000	16.508,20
PROSHARES SHORT 7-10YR	680,0000	24,73273747	16.818,26
IPATH GLOBAL CARBON ETN	3.170,0000	5,06554504	16.057,78
ΣΥΝΟΛΟ II.5			109.137,22

ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.169.654,01
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.224.218,83
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			7.996,77
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.232.215,60
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON STOCKS			
FTSE /ATHENS JULY17	12,0000	2.155,50000000	51.732,00
- Χρηματιστήριο: Χώρα: GREECE			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			51.732,00
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			51.732,00
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			51.732,00

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