

GMM GERAISTOS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN GBP	3.641,3000	1,36249063	4.961,24
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			139.323,48
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			199.970,00
CASH ACCOUNT IN USD	9.221,5500	0,91852668	8.470,24
ΣΥΝΟΛΟ I.1			352.724,96
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			352.724,96
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	350,0000	100,00000000	35.000,00
- 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:			
BGB 1.25 22/6/2018	800,0000	103,81800000	83.054,40
- Isin: BE0000329384			
- Εκδότης: BELGIUM KINGDOM			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-FEB-13 - 22-JUN-18 Επιτόκιο: 1.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: AA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PPC FINANCE 1/5/2019	1.000,0000	81,71100000	81.711,00
- 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:			
GAZPROM 3.389% 20/03/2020	1.000,0000	95,87500000	95.875,00
- 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:			
CEMEX FINANCE LLC 1/4/2021	1.000,0000	97,50000000	97.500,00
- Isin: XS1028960174			
- Εκδότης: CEMEX FINANCE LLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-APR-14 - 01-APR-21 Επιτόκιο: 5.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GM 4.375 25/9/2021	300,0000	93,00082667	27.900,25
- Isin: US37045XAAQ97			
- Εκδότης: GENERAL MOTORS FINL CO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-SEP-14 - 25-SEP-21 Επιτόκιο: 4.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			

ENDESA 15/4/2024	660,0000	91,10958023	60.132,32
- 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:			
GLENCORE 1.75 17/3/2025	1.000,0000	62,99900000	62.999,00
- Isin: XS1202849086			
- Εκδότης: GLENCORE FINANCE EUROPE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-15 - 17-MAR-25 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			544.171,97
ΣΥΝΟΛΟ II.1			544.171,97
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	102,18679747	53.775,80
- Isin: GB00BBHXP512			
- 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			53.775,80
ΣΥΝΟΛΟ II.2			53.775,80
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLOBO PLC -GBO LN	24.000,0000	0,01362491	327,00
NAVIOS MARITIME HOLDINGS	430,0000	1,60742170	691,19
PUBLIC POWER CORP.	3.230,0000	3,88000000	12.532,40
TERNA ENERGY SA	5.950,0000	2,46000000	14.637,00
LUKOIL PJSC-SPON ADR	520,0000	29,83833930	15.515,94
EUROBANK	94.421,0000	1,04000000	98.197,84
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	2.020,0000	8,10000000	16.362,00
VALE SA-SP ADR	6.950,0000	3,02195279	21.002,57
ORACLE CORP	675,0000	33,55377974	22.648,80
GENERAL ELECTRIC CO	1.270,0000	28,61210618	36.337,37
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	1.340,0000	11,63314044	15.588,41
ΣΥΝΟΛΟ II.3			253.840,52
4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	9.906,0000	0,91852668	9.098,93
ΣΥΝΟΛΟ II.4			9.098,93
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
MORGAN STANLEY CHINA A	1.100,0000	18,28786626	20.116,65
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	380,0000	51,06000000	19.402,80
ΣΥΝΟΛΟ II.5			39.519,45
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			900.406,67
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.253.131,63
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			9.641,52
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.262.773,15
III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
CAD FX USD FUT MAR16	1,0000	72,33000000	66.437,03
ΣΥΝΟΛΟ III.1			66.437,03
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			66.437,03
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			66.437,03