

GMM GERAISTOS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

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 RUB | 57.080,8400 | 0,01555210 | 887,73 |
| CASH ACCOUNT IN GBP | 1.374,9000 | 1,16797870 | 1.605,85 |
| CASH ACCOUNT IN AUD | 3.329,9200 | 0,68511921 | 2.281,39 |
| EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO | | | 76.218,76 |
| CASH ACCOUNT IN CAD | 34.898,8200 | 0,70482098 | 24.597,42 |
| CASH ACCOUNT IN NOK | 452.500,0000 | 0,11005580 | 49.800,25 |
| CASH ACCOUNT IN USD | 2.856,4100 | 0,94867660 | 2.709,81 |
| ΣΥΝΟΛΟ I.1 | | | 158.101,21 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I) | | | 158.101,21 |
| II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΑ | | | |
| FIXED | | | |
| INTL FINANCE 17/12/2018 | 12.000,0000 | 1,58363919 | 19.003,67 |
| - Isin: XS1333828280 | | | |
| - Εκδότης: INTL FINANCE CORP | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-DEC-15 - 17-DEC-18 Επιδόκιο: 8.75% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| PPC FINANCE 1/5/2019 | 1.000,0000 | 86,68200000 | 86.682,00 |
| - Isin: XS1063837741 | | | |
| - Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19 Επιδόκιο: 5,5% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| FORD MOTOER 2/6/2020 | 1.300,0000 | 68,64209372 | 89.234,72 |
| - Isin: XS1423777561 | | | |
| - Εκδότης: FORD MOTOR CREDIT CO | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-JUN-16 - 02-JUN-20 Επιδόκιο: 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 Επιδόκιο: 6% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021 | 1.500,0000 | 101,30158429 | 151.952,38 |
| - Isin: USP04808AA23 | | | |
| - Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-16 - 22-APR-21 Επιδόκιο: 6.875% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21 | 1.000,0000 | 99,56500000 | 99.565,00 |
| - Isin: XS1500377517 | | | |
| - Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-16 - 14-OCT-21 Επιδόκιο: 4.875% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |

| | | | |
|--|-------------|--------------|---------------------|
| ECOPETROL SA 18/9/2043 | 570,0000 | 96,23849730 | 54.855,94 |
| - 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 | | | 526.293,71 |
| STEPPED | | | |
| GGB 3% 24/2/26 | 1.000,0000 | 77,67700000 | 77.677,00 |
| - 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 | | | 77.677,00 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.1 | | | 603.970,71 |
| 2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ | | | |
| FIXED | | | |
| GLOBO TECH 6% 20/6/2018 | 625,4457 | 49,42000000 | 30.909,53 |
| - Isin: GB00BBHXPS12 | | | |
| - Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 6% | | | |
| - 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 | | | 37.509,53 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.2 | | | 37.509,53 |
| 3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ | | | |
| NAVIOS MARITIME HOLDINGS | 430,0000 | 1,33763400 | 575,18 |
| QUALITY & RELIABILITY SA | 13.488,0000 | 0,33100000 | 4.464,53 |
| TERNA ENERGY SA | 5.950,0000 | 2,81000000 | 16.719,50 |
| GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA | 2.020,0000 | 8,40000000 | 16.968,00 |
| ΤΡΑΠΕΖΑ ALPHA BANK | 10.500,0000 | 1,90000000 | 19.950,00 |
| EUROBANK | 94.421,0000 | 0,64500000 | 60.901,55 |
| ORACLE CORP | 675,0000 | 36,47661512 | 24.621,72 |
| POTASH CORP | 1.450,0000 | 17,12010149 | 24.824,15 |
| PUBLIC POWER CORP. | 9.330,0000 | 2,89000000 | 26.963,70 |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR | 520,0000 | 53,22075704 | 27.674,79 |
| MMC NORILSK NICKEL JSC ADR | 2.530,0000 | 15,92828005 | 40.298,55 |
| MYTILINEOS HOLDINGS S.A. | 3.250,0000 | 6,15000000 | 19.987,50 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.3 | | | 283.949,17 |
| 4. MARGIN | | | |
| MARGIN IN USD/BETA | 9.296,9100 | 0,94867660 | 8.819,76 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.4 | | | 8.819,76 |
| 5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ | | | |
| PROSHARES ULTRA BLOOM. CR | 350,0000 | 11,08054264 | 3.878,19 |
| PROSHARES SHORT 7-10YR | 680,0000 | 27,57793378 | 18.752,99 |
| PROSHARES SHORT MSCI EMR MKT | 1.800,0000 | 23,67896784 | 42.622,14 |
| IPATH GLOBAL CARBON ETN | 3.170,0000 | 7,21942890 | 22.885,59 |
| LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO | 1.180,0000 | 16,81000000 | 19.835,80 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.5 | | | 107.974,71 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II) | | | 1.042.223,88 |

| | |
|---|---------------------|
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) | 1.200.325,09 |
| ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ | 7.132,86 |
| ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ | 1.207.457,95 |
| ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV) | 0,00 |

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