

GMM GERAISTOS 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 GBP	6.023,2000	1,26334407	7.609,37
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			120.000,03
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			43.438,03
CASH ACCOUNT IN USD	11.120,9500	0,87834870	9.768,07
ΣΥΝΟΛΟ I.1			180.815,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			180.815,50
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΔ			
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	103,80400000	83.043,20
- 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	73,28900000	73.289,00
- 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	99,87500000	99.875,00
- 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	100,37500000	100.375,00
- 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	90,68950373	27.206,85
- 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	91,23583663	60.215,65
- 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	75,34900000	75.349,00
- 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			554.353,70
ΣΥΝΟΛΟ II.1			554.353,70
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	75,80064431	39.890,09
- 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			39.890,09
ΣΥΝΟΛΟ II.2			39.890,09
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
NAVIOS MARITIME HOLDINGS	430,0000	0,99253404	426,79
PUBLIC POWER CORP.	3.230,0000	3,14000000	10.142,20
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	2.020,0000	6,18000000	12.483,60
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	1.340,0000	11,33948177	15.194,91
TERNA ENERGY SA	5.950,0000	2,85000000	16.957,50
EUROBANK	94.421,0000	0,77900000	73.553,96
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	80.500,0000	0,22700000	18.273,50
ΤΡΑΠΕΖΑ ALPHA BANK	10.500,0000	1,96000000	20.580,00
ORACLE CORP	675,0000	35,93324550	24.254,94
VALE SA-SP ADR	6.950,0000	3,69784805	25.700,04
GENERAL ELECTRIC CO	1.270,0000	27,92270531	35.461,84
LUKOIL PJSC-SPON ADR	520,0000	33,94817743	17.653,05
ΣΥΝΟΛΟ II.3			270.682,33
4. ΜΕΤΟΧΕΣ ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLOBO PLC -GBO LN	24.000,0000	0,01263344	303,20
ΣΥΝΟΛΟ II.4			303,20
5. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	7.119,5600	0,87834870	6.253,46
ΣΥΝΟΛΟ II.5			6.253,46
6. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	380,0000	50,38000000	19.144,40
MORGAN STANLEY CHINA A	1.100,0000	14,86166008	16.347,83
ΣΥΝΟΛΟ II.6			35.492,23
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			906.975,01
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.087.790,51
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			33.760,11
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.121.550,62

III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

CAD FX USD FUT JUN16	1,0000	77,07000000	67.694,33
ΣΥΝΟΛΟ III.1			67.694,33
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			67.694,33
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			67.694,33

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