

GMM GLOBAL OPPORTUNITIES BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	147,0500	0,10907147	16,04
CASH ACCOUNT IN DKK	2.277,6000	0,13444655	306,22
CASH ACCOUNT IN AUD	1.955,8400	0,71520526	1.398,83
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			93.371,70
CASH ACCOUNT IN RUB	213.930,4600	0,01658017	3.547,00
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			633,06
CASH ACCOUNT IN CAD	3.354,1400	0,70101647	2.351,31
ΣΥΝΟΛΟ I.1			101.624,16
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	500,0000	107,21950000	53.609,75
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			53.609,75
ΣΥΝΟΛΟ I.2			53.609,75
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			155.233,91
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	490,0000	71,84451438	35.203,81
- Isin: AU3CB0197572			
- Εκδότης: EXPORT DEVELOPMNT CANADA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-AUG-12 - 08-AUG-17			Επιτόκιο: 3.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	1.100,0000	30,11656805	33.128,22
- Isin: XS1136802615			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-NOV-14 - 19-JUN-18			Επιτόκιο: 10%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	39.000,0000	1,68353423	65.657,83
- 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:			
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:			
OPAP 21/3/2022	600,0000	100,66000000	60.396,00
- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22			Επιτόκιο: 3.5%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			219.385,86
OTHER			
OESTERREICH VOLKSBANKEN 10% PERP.	200,0000	17,75000000	3.550,00
- Isin: XS0359924643			
- Εκδότης: IMMIGON PORTFOLIOABBAU			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-08 - 18-JUN-18			Επιτόκιο: 10%
- Τύπος Επιτοκίου: Other			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Cu /*+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ OTHER			3.550,00
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	93,50000000	93.500,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27			Επιτόκιο: 5%
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			93.500,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			316.435,86
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			
MYTILINEOS HOLDINGS S.A.	2.900,0000	7,10000000	20.590,00
CIA SIDER. NAEL -SP ADR	10.600,0000	2,73126929	28.951,45
LANXESS AG	470,0000	62,89000000	29.558,30
YPF SA ADR	1.350,0000	22,71069124	30.659,43
PETROLEO BRASILEIRO S.A.	3.570,0000	9,06369844	32.357,40
UBS GROUP	2.200,0000	14,98691099	32.971,20
QUALITY & RELIABILITY SA	146.733,0000	0,19900000	29.199,87
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	2.500,0000	14,70395660	36.759,89
ROYAL BANK OF SCOTLAND	14.000,0000	2,82982479	39.617,55
NATIXIS	7.100,0000	5,77600000	41.009,60
VALLOUREC SA	6.800,0000	6,22400000	42.323,20
GRUPO FINANCIERO GALICIA ADR	1.250,0000	35,41296418	44.266,21

STATE BANK OF INDI GDR REG S	1.080,0000	41,76410065	45.105,23
POTASH CORP	2.250,0000	15,97605463	35.946,12
ΣΥΝΟΛΟ II.3			489.315,45
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			39.862,94
MARGIN IN USD/BETA	9.274,0700	0,93536620	8.674,65
ΣΥΝΟΛΟ II.4			48.537,59
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	2.200,0000	26,73276588	58.812,08
ISHARES MSCI FRONTIER 100	1.050,0000	25,94705827	27.244,41
ΣΥΝΟΛΟ II.5			86.056,49
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			977.854,92
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			
			1.133.088,83
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			
			3.359,24
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.136.448,07
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON CURRENCY			
EUR FX USD FUT JUN17	2,0000	1,07220000	250.724,91
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			250.724,91
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			250.724,91
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			250.724,91

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