

HELLAS -CYPRUS RECOVERY FUND A/K

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
			ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	7,3000	0,90073861	6,58
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			244.340,42
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			100.215,60
CASH ACCOUNT IN GBP	9.497,1500	1,20992136	11.490,80
ΣΥΝΟΛΟ I.1			356.053,40
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	1.000,0000	106,55650000	106.556,50
- Isin: XS0483954144			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-10 - 03-FEB-20	Επιτόκιο: 4.625%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	1.000,0000	102,61250000	102.612,50
- Isin: XS1227247191			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-15 - 06-MAY-22	Επιτόκιο: 3.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			209.169,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			209.169,00
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
HELLENIC BANK PUBLIC CO LTD	1.940,0000	0,83900000	1.627,66
LORDOS HOTELS HOLDINGS PLC	25.000,0000	0,23000000	5.750,00
ERMES DEPARTMENT STORES PLC	75.000,0000	0,10000000	7.500,00
PETROLINA HOLDINGS LTD	8.300,0000	0,98000000	8.134,00
WOOLWORTH CYPRUS PROPERTIES	64.126,0000	0,23500000	15.069,61
A TSOKKOS HOTELS PLC	122.000,0000	0,08200000	10.004,00
LOUIS PLC	346.000,0000	0,03700000	12.802,00
CYPRUS CEMENT CO PLC	42.909,0000	0,31900000	13.687,97
CCC TOURIST ENTERPRISES PLC	177.900,0000	0,04700000	8.361,30
ΣΥΝΟΛΟ I.3			82.936,54
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			648.158,94
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
HELLENIC PETROLEUM 8% 10/05/17	1.000,0000	101,58400000	101.584,00
- Isin: XS0926848572			
- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-MAY-13 - 10-MAY-17	Επιτόκιο: 8%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	1.400,0000	100,00000000	140.000,00
- 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:			
GGB 4.75% 17/04/2019	500,0000	89,73100000	44.865,50
- Isin: GR0114028534			

- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-APR-14 - 17-APR-19	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			286.449,50
ΣΥΝΟΛΟ II.1			286.449,50
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	1.052,5000	90,74410163	95.508,17
- 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			95.508,17
ΣΥΝΟΛΟ II.2			95.508,17
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
QUALITY & RELIABILITY SA	42.508,0000	0,32500000	13.815,10
EUROBANK	51.700,0000	0,55000000	28.435,00
HELLENIC EXCHANGES ATH	7.550,0000	4,26000000	32.163,00
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	205.000,0000	0,16100000	33.005,00
ΜΥΤΙΛΙΝΕΟΣ HOLDINGS S.A.	9.300,0000	3,77000000	35.061,00
PIRAEUS PORT AUTHORITY SA	7.500,0000	12,20000000	91.500,00
TERNA ENERGY SA	16.000,0000	2,41000000	38.560,00
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	6.800,0000	6,22000000	42.296,00
HELLENIC TELECOM ORG	5.450,0000	8,07000000	43.981,50
ΤΡΑΠΕΖΑ ALPHA BANK	32.000,0000	1,62000000	51.840,00
LAMDA DEVELOPMENT	15.000,0000	4,33000000	64.950,00
NATIONAL BANK OF GREECE	191.000,0000	0,19200000	36.672,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			512.278,60
4. MARGIN			
MARGIN CLASS 1 IN EURO			1.269,43
MARGIN IN GBP/BETA	9.044,5500	1,20992136	10.943,19
ΣΥΝΟΛΟ II.4			12.212,62
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			906.448,89
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.554.607,83
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			17.718,45
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.572.326,28
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EURO FX GBP CURR sep16	1,0000	0,83845000	126.807,32
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE	Χώρα: UNITED STATES		
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			126.807,32
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			126.807,32
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			126.807,32

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