

GMM HERMES BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ		ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ					
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ					
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO				56.768,08	
CASH ACCOUNT IN USD	20.547,7000		0,89597706	18.410,27	
ΣΥΝΟΛΟ I.1				75.178,35	
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ					
FIXED					
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.500,0000		106,45650000	266.141,25	
- 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: B+					
- Πρόσθετοι Όροι:					
ΣΥΝΟΛΟ FIXED				266.141,25	
ΣΥΝΟΛΟ I.2				266.141,25	
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)				341.319,60	
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ					
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΓΑ					
FIXED					
EUROBANK HELLAS PLC 26/06/2018	2.490,0000		92,89100000	231.298,59	
- Isin: XS1081588086					
- Εκδότης: ERB HELLAS PLC					
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 26-JUN-18					Επιτόκιο: 4.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed					Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ca					
- Πρόσθετοι Όροι:					
BAO TRANS ENTERE 12/12/2018	2.000,0000		91,94516620	183.890,33	
- Isin: XS1001851994					
- Εκδότης: BAO-TRANS ENTERPRISE					
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-DEC-13 - 12-DEC-18					Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed					Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2					
- Πρόσθετοι Όροι:					
INTL FINANCE 17/12/2018	410.000,0000		1,43886320	589.933,91	
- 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:					
PPC FINANCE 1/5/2019	8.600,0000		82,19800000	706.902,80	
- 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:					
MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019	7.400,0000		103,05900000	762.636,60	
- Isin: XS1066486629					
- Εκδότης: MOTOR OIL FINANCE PLC					
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-14 - 15-MAY-19					Επιτόκιο: 5.125%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed					Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA					
- Πρόσθετοι Όροι:					

HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19	7.500,0000	101,04500000	757.837,50
- Isin: XS1083287547			
- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JUL-14 - 04-JUL-19 Επιτόκιο: 5.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PFOURS 6.5 1/8/2019	3.600,0000	103,37500000	372.150,00
- Isin: XS0982709494			
- Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-AUG-19 Επιτόκιο: 6.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE 3.5% 09/07/2020	3.700,0000	101,02900000	373.807,30
- Isin: XS1086785182			
- Εκδότης: OTE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-JUL-14 - 09-JUL-20 Επιτόκιο: 3.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
LOCKHEED 23/11/2020	2.400,0000	92,58489383	222.203,75
- Isin: US539830BF54			
- Εκδότης: LOCKHEED MARTIN CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-NOV-15 - 23-NOV-20 Επιτόκιο: 2.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL 15/5/2021	4.000,0000	98,52500000	394.100,00
- Isin: XS1064899120			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 15-MAY-21 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
THOMAS COOK 15/6/2021	3.700,0000	102,25000000	378.325,00
- Isin: XS1172436211			
- Εκδότης: THOMAS COOK FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-JAN-15 - 15-JUN-21 Επιτόκιο: 6.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BARRICK 3.85% 1/4/2022	2.500,0000	95,36690261	238.417,26
- Isin: US067901AL20			
- Εκδότης: BARRICK GOLD CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-12 - 01-APR-22 Επιτόκιο: 3.85%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALE 3.75% 10/1/2023	4.100,0000	101,25000000	415.125,00
- Isin: XS0802953165			
- Εκδότης: VALE OVERSEAS LIMITED			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-JUL-12 - 10-JAN-23 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CEMEX 05/03/2023 4.375%	3.700,0000	102,25000000	378.325,00
- Isin: XS1198002690			
- Εκδότης: CEMEX SAB DE CV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-MAR-15 - 05-MAR-23 Επιτόκιο: 4.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			6.004.953,04

STEPPED			
GGB 3% 24/02/2038	7.000,0000	58,31300000	408.191,00
- Isin: GR0138010765			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-38	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			408.191,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			6.413.144,04
2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
EUROBANK	160.000,0000	0,50800000	81.280,00
NATIONAL BANK OF GREECE	1.300.000,0000	0,18400000	239.200,00
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	700.000,0000	0,13400000	93.800,00
ΣΥΝΟΛΟ II.2			414.280,00
3. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ISHARES EM LOCAL GOV BND	10.500,0000	58,89000000	618.345,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			618.345,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			7.445.769,04
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			7.787.088,64
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			143.097,55
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			7.930.186,19

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