

ΓΜΜ ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ ΥΨΗΛΗΣ ΠΙΣΤΟΛΗΠΤΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Β

| ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ | ΤΕΜΑΧΙΑ | ΤΙΜΗ | ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ |
|---|------------------|----------------------------|----------------------------|
| | | ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ | ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ |
| I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ | | | |
| CASH ACCOUNT IN USD | 179.333,3400 | 0,87627059 | 157.144,53 |
| EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO | | | 1.993,80 |
| ΣΥΝΟΛΟ I.1 | | | 159.138,33 |
| 2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ | | | |
| FIXED | | | |
| CYPRUS 2 18/1/2018 | 620,0000 | 102,31750000 | 63.436,85 |
| - Isin: CY0146220815 | | | |
| - Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18 | Επιτόκιο: 2% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | Πηγή: BLOOMBERG | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| REP OF CYPRUS 27/06/2024 | 1.090,0000 | 102,56250000 | 111.793,13 |
| - Isin: XS1637276848 | | | |
| - Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-JUN-17 - 27-JUN-24 | Επιτόκιο: 2.75% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | Πηγή: BLOOMBERG | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ FIXED | | | 175.229,98 |
| ΣΥΝΟΛΟ I.2 | | | 175.229,98 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I) | | | 334.368,31 |
| II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ | | | |
| FIXED | | | |
| EUROPEAN INV 10 19/6/2018 | 5.200,0000 | 27,22154255 | 141.552,02 |
| - 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: | | | |
| BANCO DO BRAZIL, 25/7/2018 3.75% | 1.000,0000 | 102,75000000 | 102.750,00 |
| - Isin: XS0955552178 | | | |
| - Εκδότης: BANCO DO BRASIL (CAYMAN) | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUL-13 - 25-JUL-18 | Επιτόκιο: 3.75% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | Πηγή: BLOOMBERG | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| INTL FINANCE 17/12/2018 | 100.000,0000 | 1,50366645 | 150.366,64 |
| - 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: | | | |
| STATE BANK INDIA 17/4/2019 | 2.000,0000 | 89,17718191 | 178.354,36 |
| - Isin: USY81647AA02 | | | |
| - Εκδότης: STATE BANK INDIA/LONDON | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-APR-14 - 17-APR-19 | Επιτόκιο: 3.622% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | Πηγή: BLOOMBERG | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| NORWEGIAN GOV 22/5/2019 | 10.400,0000 | 11,20965804 | 116.580,44 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------------|-------------------|
| - Isin: NO0010429913 | | | |
| - Εκδότης: NORWEGIAN GOVERNMENT | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-08 - 22-MAY-19 | | Επιτόκιο: 4.5% | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | | Πηγή: BLOOMBERG | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| OTE 3.5% 09/07/2020 | 1.000,0000 | 103,84000000 | 103.840,00 |
| - 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: | | | |
| Q & R UK LTD 21/7/2017 6 | 1.250,0000 | 100,00000000 | 125.000,00 |
| - 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: | | | |
| GERDAU TRADE 30/1/2021 | 1.000,0000 | 91,92954784 | 91.929,55 |
| - Isin: USG3925DAA84 | | | |
| - Εκδότης: GERDAU TRADE INC | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21 | | Επιτόκιο: 5.75% | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | | Πηγή: BLOOMBERG | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ONGC VIDESH 15/7/2021 | 1.000,0000 | 106,20800000 | 106.208,00 |
| - Isin: XS1084958989 | | | |
| - Εκδότης: ONGC VIDESH LTD | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-21 | | Επιτόκιο: 2.75% | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | | Πηγή: BLOOMBERG | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21 | 2.000,0000 | 105,21600000 | 210.432,00 |
| - Isin: XS1500377517 | | | |
| - Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-16 - 14-OCT-21 | | Επιτόκιο: 4.875% | |

| | | | |
|---|-------------------|---------------------|---------------------|
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| SYSTEMS SUNLIGHT ABEE 20/6/2022 | 230,0000 | 100,65000000 | 23.149,50 |
| - Isin: GRC8121176B9 | | | |
| - Εκδότης: SYSTEMS SUNLIGHT ABEE | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-17 - 20-JUN-22 | Επιτόκιο: 4.25% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1% | 710,0000 | 100,31000000 | 71.220,10 |
| - Isin: GRC3931176B0 | | | |
| - Εκδότης: MYTILINEOS HOLDINGS S.A. | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-17 - 26-JUN-22 | Επιτόκιο: 3.1% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI 4/5/2026 | 1.000,0000 | 108,23200000 | 108.232,00 |
| - Isin: XS1062900912 | | | |
| - Εκδότης: ASSICURAZIONI GENERALI | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-MAY-14 - 04-MAY-26 | Επιτόκιο: 4.125% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| NTPC 2.75 1/2/2027 | 1.000,0000 | 104,59300000 | 104.593,00 |
| - Isin: XS1551677260 | | | |
| - Εκδότης: NTPC LTD | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-FEB-17 - 01-FEB-27 | Επιτόκιο: 2.75% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 10/2/2027 | 1.000,0000 | 107,44100000 | 107.441,00 |
| - Isin: XS1562614831 | | | |
| - Εκδότης: BANCO BILBAO VIZCAYA ARG | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-FEB-17 - 10-FEB-27 | Επιτόκιο: 3.5% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ FIXED | | | 1.741.648,61 |
| FLOATING | | | |
| GOLDMAN SACHS 15/11/2021 | 1.000,0000 | 88,42271293 | 88.422,71 |
| - Isin: US38145GAF72 | | | |
| - Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21 | Επιτόκιο: 2.3518% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022 | 1.000,0000 | 94,53645286 | 94.536,45 |
| - Isin: US71656MBN83 | | | |
| - Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22 | Επιτόκιο: 4.8781% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ FLOATING | | | 182.959,16 |
| ZERO COUPON | | | |
| GTB 0 08/09/17 | 1.000,0000 | 99,57900000 | 99.579,00 |
| - Isin: GR0000167701 | | | |
| - Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUN-17 - 08-SEP-17 | Επιτόκιο: 0% | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG | | | |

| | | | |
|---|-------------|---------------------|---------------------|
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON | | | 99.579,00 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.1 | | | 2.024.186,77 |
| 2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ | | | |
| FIXED | | | |
| GLOBO TECH 6% 20/6/2018 | 3.314,8621 | 46,62000000 | 154.538,87 |
| - Isin: GB00BBHXPS12 | | | |
| - Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 | | Επιτόκιο: 0% | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed | | Πηγή: BLOOMBERG | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| CELTONA LTD 15/12/2019 | 327,0000 | 100,00000000 | 32.700,00 |
| - 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 | | | 187.238,87 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.2 | | | 187.238,87 |
| 3. MARGIN | | | |
| MARGIN IN USD/BETA | 69.983,5200 | 0,87627059 | 61.324,50 |
| MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX | | | 33.513,78 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.3 | | | 94.838,28 |
| 4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ | | | |
| PROSHARES SHORT 7-10YR | 6.550,0000 | 24,73273747 | 161.999,43 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.4 | | | 161.999,43 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II) | | | 2.468.263,35 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) | | | 2.802.631,66 |
| ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ | | | 635.607,83 |
| ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ | | | 3.438.239,49 |
| | | | |
| IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1. FUTURES ON CURRENCY | | | |
| EURO FX USD CURR FUT SEP17 | 6,0000 | 1,14670000 | 753.614,62 |
| - Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | | Χώρα: UNITED STATES | |
| ΣΥΝΟΛΟ IV.1 | | | 753.614,62 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV) | | | 753.614,62 |
| ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV) | | | 753.614,62 |

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