

ΓΜΜ ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ ΥΨΗΛΗΣ ΠΙΣΤΟΛΗΠΤΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

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 AUD	513,8500	0,66983723	344,20
CASH ACCOUNT IN CAD	2.776,7300	0,69521691	1.930,43
CASH ACCOUNT IN USD	8.490,9000	0,90073861	7.648,08
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			861.889,43
CASH ACCOUNT IN GBP	14.218,8100	1,20992136	17.203,64
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			429.970,00
CASH ACCOUNT IN NOK	90.441,9500	0,10751763	9.724,10
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.328.709,88
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	620,0000	99,71050000	61.820,51
- 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: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	600,0000	102,61250000	61.567,50
- 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:			
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022	13.500,0000	11,01432135	148.693,34
- Isin: XS1227593933			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-MAY-15 - 12-MAY-22 Επιτόκιο: 1.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			272.081,35
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 5/8/2016	2.000,0000	99,75200000	199.504,00
- Isin: CY0146480815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-16 - 05-AUG-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 2/9/2016	5.000,0000	99,50900000	497.545,00
- Isin: CY0146530817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-16 - 02-SEP-16 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			697.049,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			969.130,35
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.297.840,23

II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΑ

FIXED

Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	1.750,0000	100,00000000	175.000,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
OTE PLC 7,875% 07/02/2018	2.000,0000	106,31400000	212.628,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0885718782 - Εκδότης: OTE PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-FEB-13 - 07-FEB-18 Επιτόκιο: 7.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+ - Πρόσθετοι Όροι: 			
BAO TRANS ENTERPRICE	2.000,0000	100,02600000	200.052,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1181873776 - Εκδότης: BAO-TRANS ENTERPRISE - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-FEB-15 - 23-FEB-18 Επιτόκιο: 1.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
BHARTI 4 10/12/18	1.000,0000	107,13600000	107.136,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0997979249 - Εκδότης: BHARTI AIRTEL INTERNATIO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-DEC-13 - 10-DEC-18 Επιτόκιο: 4% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GENERAL MOT. 15/10/2019	2.000,0000	103,87500000	207.750,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1121198094 - Εκδότης: GENERAL MOTORS FINANCIAL - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-OCT-14 - 15-OCT-19 Επιτόκιο: 1.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.000,0000	100,69200000	100.692,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1327539976 - Εκδότης: OTE PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-15 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: 4.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
SINOPEC 17/10/2020	1.000,0000	106,42100000	106.421,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0982303785 - Εκδότης: SINOPEC GRP OVERSEA 2013 - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-OCT-13 - 17-OCT-20 Επιτόκιο: 2.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ANADARKO PETR. 15/3/2021	1.000,0000	95,47739146	95.477,39
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US032511BM81 - Εκδότης: ANADARKO PETROLEUM CORP - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-16 - 15-MAR-21 Επιτόκιο: 4.85% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
BHARTI 3.375 20/05/21	2.000,0000	107,89400000	215.788,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1028954953 - Εκδότης: BHARTI AIRTEL INTERNATIO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-14 - 20-MAY-21 Επιτόκιο: 3.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			

KELLOGG 1.75 24/5/2021	1.000,0000	105,68800000	105.688,00
- Isin: XS1070075988			
- Εκδότης: KELLOGG CO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-MAY-14 - 24-MAY-21 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF INDONESIA 8/7/2021	2.000,0000	104,06900000	208.138,00
- Isin: XS1084367942			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUL-14 - 08-JUL-21 Επιτόκιο: 2.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
HUTCH 31/10/2021	1.500,0000	102,40600000	153.609,00
- Isin: XS1132402709			
- Εκδότης: HUTCH WHAMPOA FINANCE 14			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-OCT-14 - 31-OCT-21 Επιτόκιο: 1.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
KONINKLIJKE 15/3/2022	1.200,0000	96,66726716	116.000,72
- Isin: US500472AF27			
- Εκδότης: KONINKLIJKE PHILIPS NV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-MAR-12 - 15-MAR-22 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ABXCN 4.1% 1/5/2023	1.500,0000	95,15402630	142.731,04
- Isin: US067901AQ17			
- Εκδότης: BARRICK GOLD CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-SEP-13 - 01-MAY-23 Επιτόκιο: 4.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	26.800,0000	11,62459143	311.539,05
- Isin: NO0010646813			
- Εκδότης: NORWEGIAN KINGOM			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-MAY-12 - 24-MAY-23 Επιτόκιο: 2%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CODELCO INC 9/7/2024	1.400,0000	97,91600000	137.082,40
- Isin: XS1084942470			
- Εκδότης: CODELCO INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-JUL-14 - 09-JUL-24 Επιτόκιο: 2.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
AIRBUS 1.375 13/5/2031	2.000,0000	101,41100000	202.822,00
- Isin: XS1410582313			
- Εκδότης: AIRBUS GROUP FINANCE BV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-MAY-16 - 13-MAY-31 Επιτόκιο: 1.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			2.798.554,60
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.798.554,60

2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

FIXED

GLOBO TECH 9% 20/6/2018	3.157,5000	90,74410163	286.524,50
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επικόκιο: 9%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			286.524,50

ΣΥΝΟΛΟ II.2

286.524,50

3. MARGIN

MARGIN IN USD/ΒΕΤΑ	4.246,6800	0,90073861	3.825,15
MARGIN ΒΕΤΑ SEC IN EURO / EUREX			29.191,01
MARGIN IN GBP/ΒΕΤΑ	14.412,5000	1,20992136	17.437,99
ΣΥΝΟΛΟ II.3			50.454,15

4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

ISHARES SILVER TRUST	4.200,0000	16,09169519	67.585,12
ETFs PRECIOUS METALS	22.400,0000	16,33500000	365.904,00
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	3.900,0000	51,30000000	200.070,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			633.559,12
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			3.769.092,37

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

6.066.932,60

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

30.104,12

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

6.097.036,72

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EURO FX GBP CURR sep16	2,0000	0,83845000	253.614,64
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

253.614,64

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

253.614,64

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

253.614,64

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