

ΓΜΜ ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ ΥΨΗΛΗΣ ΠΙΣΤΟΛΗΠΤΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN AUD	107,9400	0,68226786	73,64
CASH ACCOUNT IN CAD	2.776,7300	0,68073519	1.890,22
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			619.519,70
CASH ACCOUNT IN USD	137.247,3600	0,89597706	122.970,49
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			79.740,00
CASH ACCOUNT IN GBP	17.586,0500	1,16139972	20.424,43
ΣΥΝΟΛΟ I.1			844.618,48
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	620,0000	100,80850000	62.501,27
- 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 3.75 26/7/2023	1.400,0000	103,16950000	144.437,30
- Isin: XS1457553367			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUL-16 - 26-JUL-23			Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			206.938,57
ZERO COUPON			
CYPRUS T-BILL 07/10/2016	1.000,0000	99,98500000	99.985,00
- Isin: CY0146570813			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUL-16 - 07-OCT-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4/11/2016	1.620,0000	99,84900000	161.755,38
- Isin: CY0146620816			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-AUG-16 - 04-NOV-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			261.740,38
ΣΥΝΟΛΟ I.2			468.678,95
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			1.313.297,43
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	1.750,0000	100,00000000	175.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17			Επιτόκιο: 6%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			

OTE PLC 7,875% 07/02/2018	2.000,0000	107,01200000	214.024,00
- 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	101,04500000	202.090,00
- 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:			
GENERAL MOT. 15/10/2019	2.000,0000	104,62500000	209.250,00
- 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:			
PIRELLI INT 18/11/2019	2.000,0000	100,82800000	201.656,00
- Isin: XS1139287350			
- Εκδότης: PIRELLI INTERNATIONAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-NOV-14 - 18-NOV-19 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.000,0000	103,32000000	103.320,00
- 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	108,06300000	108.063,00
- 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	96,44117911	96.441,18
- 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:			
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022	13.500,0000	11,28092138	152.292,44
- 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:			
ABXCN 4.1% 1/5/2023	1.500,0000	96,65800556	144.987,01
- 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	13.400,0000	11,82685139	158.479,81
- Isin: NO0010646813			
- Εκδότης: NORWEGIAN KINGDOM			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-MAY-12 - 24-MAY-23	Επιτόκιο: 2%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
AUSTRALIAN GOVERNMENT 21/4/2024	4.000,0000	72,40226513	289.609,06
- Isin: AU3TB0000143			
- Εκδότης: AUSTRALIAN GOVERNMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-APR-12 - 21-APR-24	Επιτόκιο: 2.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF COLOMBIA 22/3/2026	1.500,0000	113,40200000	170.103,00
- Isin: XS1385239006			
- Εκδότης: REPUBLIC OF COLOMBIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-16 - 22-MAR-26	Επιτόκιο: 3.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
KINDER MORGAN/DELAWA 16/3/2027	1.500,0000	100,95100000	151.426,50
- Isin: XS1196817586			
- Εκδότης: KINDER MORGAN INC /DELAWA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-MAR-15 - 16-MAR-27	Επιτόκιο: 2.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή:		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			2.376.742,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.376.742,00
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	3.157,5000	58,06998595	183.355,98
- Isin: GB00BBHXP512			
- 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			183.355,98
ΣΥΝΟΛΟ II.2			183.355,98
3. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	4.230,6800	0,89597706	3.790,59
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			11.313,37
MARGIN IN GBP/BETA	29.897,5000	1,16139972	34.722,95
ΣΥΝΟΛΟ II.3			49.826,91
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ISHARES EM ASIA MLCL GOV BND	930,0000	85,84000000	79.831,20
ETF5 PRECIOUS METALS	14.680,0000	16,23500000	238.329,80
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	3.900,0000	49,22000000	191.958,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			510.119,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			3.120.043,89
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			4.433.341,32
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			27.245,88
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			4.460.587,20

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES ON CURRENCY

EURO FX GBP CURR FUT DEC16	2,0000	0,86765000	251.922,12
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

251.922,12

2. OPTIONS ON STOCKS

OPTION DAX 12/16/16	52,0000	13,90000000	3.614,00
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT Χώρα: GERMANY			

ΣΥΝΟΛΟ IV.2

3.614,00

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

255.536,12

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

255.536,12

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