

ΓΜΜ ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ ΥΨΗΛΗΣ ΠΙΣΤΟΛΗΠΤΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	3.772,3800	0,94867660	3.578,77
CASH ACCOUNT IN AUD	6.320,2400	0,68511921	4.330,12
CASH ACCOUNT IN CAD	9.247,3100	0,70482098	6.517,70
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			673.644,98
CASH ACCOUNT IN GBP	17.586,0500	1,16797870	20.540,13
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			299.580,00
CASH ACCOUNT IN RUB	543.557,5500	0,01555210	8.453,46
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.016.645,16
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	620,0000	101,28850000	62.798,87
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			62.798,87
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 9/1/2017	1.000,0000	99,98400000	99.984,00
- Isin: CY0146800814			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-OCT-16 - 09-JAN-17 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			99.984,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			162.782,87
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			
1.179.428,03			
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	3.940,0000	68,97437654	271.759,04
- Isin: AU3CB0197572			
- Εκδότης: EXPORT DEVELOPMNT CANADA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-AUG-12 - 08-AUG-17 Επιτόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE PLC 7,875% 07/02/2018	1.000,0000	105,96800000	105.968,00
- 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	100,97800000	201.956,00
- 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:			
INTL FINANCE 17/12/2018	50.000,0000	1,58363919	79.181,96
- 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	97,09040888	194.180,82
- 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:			
PIRELLI INT 18/11/2019	2.000,0000	101,31500000	202.630,00
- 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:			
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:			
SINOPEC 17/10/2020	1.000,0000	107,63400000	107.634,00
- 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:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	1.000,0000	97,47652025	97.476,52
- Isin: USG3925DAA84			
- Εκδότης: GERDAU TRADE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21 Επιτόκιο: 5.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	2.000,0000	99,56500000	199.130,00
- 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:			
TORONTO DOM 22/12/2021	2.400,0000	72,41119256	173.786,86
- Isin: CA8911452R48			
- Εκδότης: TORONTO-DOMINION BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-DEC-14 - 22-DEC-21 Επιτόκιο: 2.621%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			

NOVATEK 13/12/2022	2.000,0000	93,91898302	187.837,97
- Isin: XS0864383723			
- Εκδότης: NOVATEK FIN LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-12 - 13-DEC-22 Επιτόκιο: 4.422%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALE 3.75% 10/1/2023	1.000,0000	105,25000000	105.250,00
- 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: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF COLOMBIA 22/3/2026	1.500,0000	110,63300000	165.949,50
- 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:			
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028	2.000,0000	102,01500000	204.030,00
- Isin: XS1432493440			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JUN-16 - 14-JUN-28 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			2.421.770,67
FLOATING			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.000,0000	97,57707997	97.577,08
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 4.6065%			
- Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			97.577,08
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.519.347,75
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	3.127,2284	49,42000000	154.547,63
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 6%			
- 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			187.247,63
ΣΥΝΟΛΟ II.2			187.247,63
3. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			40.897,33
MARGIN IN USD/BETA	19.064,4800	0,94867660	18.086,03
ΣΥΝΟΛΟ II.3			58.983,36

4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

PROSHARES SHORT 7-10YR	6.550,0000	27,57793378	180.635,47
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	9.970,0000	16,81000000	167.595,70
ΣΥΝΟΛΟ II.4			348.231,17
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			3.113.809,91

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ 4.293.237,94

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ 4.306.980,35

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES

EURO-BUND FUT MAR 17	2,0000	164,15000000	328.300,00
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT Χώρα: GERMANY			

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

328.300,00

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

328.300,00

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

328.300,00

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