

ΓΜΜ ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ ΥΨΗΛΗΣ ΠΙΣΤΟΛΗΠΤΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Α

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	0,67535625	347,03
CASH ACCOUNT IN NOK	15.432,1000	0,10621913	1.639,18
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.034.092,32
CASH ACCOUNT IN USD	5.856,2500	0,87834870	5.143,83
CASH ACCOUNT IN GBP	14.218,8100	1,26334407	17.963,25
CASH ACCOUNT IN CAD	2.776,7300	0,67851812	1.884,06
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.061.069,67
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	620,0000	98,45500000	61.042,10
- 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	2.000,0000	102,42250000	204.845,00
- 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:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	1.000,0000	103,21850000	103.218,50
- 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			369.105,60
ΣΥΝΟΛΟ I.2			369.105,60
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			1.430.175,27
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΑ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	1.750,0000	100,00000000	175.000,00
- 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	106,98000000	213.960,00
- 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:			

BHARTI 4 10/12/18	1.000,0000	107,28300000	107.283,00
- 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	102,50000000	205.000,00
- 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:			
SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019	1.000,0000	100,25000000	100.250,00
- Isin: XS1082459568			
- Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 15-NOV-19 Επιτόκιο: 3.3524%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.000,0000	99,38700000	99.387,00
- 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	105,71800000	105.718,00
- 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:			
BHARTI 3.375 20/05/21	2.000,0000	106,90800000	213.816,00
- 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	105,25700000	105.257,00
- 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:			
HUTCH 31/10/2021	1.500,0000	101,60800000	152.412,00
- 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:			
VESTAS WIND 11/3/2022	2.000,0000	101,09800000	202.196,00
- Isin: XS1197336263			
- Εκδότης: VESTAS WIND SYSTEMS A/S			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-MAR-15 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			

KONINKLIJKE 15/3/2022	1.200,0000	92,66490997	111.197,89
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
BRF 3/6/2022	2.000,0000	92,59700000	185.194,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1242327168 - Εκδότης: BRF SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-15 - 03-JUN-22 Επιτόκιο: 2.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
SLB 2.4% 1/8/2022	1.240,0000	85,27975406	105.746,90
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: USL81445AD75 - Εκδότης: SCHLUMBERGER INVESTMENT - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JUL-12 - 01-AUG-22 Επιτόκιο: 2.4% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
CARNIVAL CORP 7/11/2022	1.000,0000	102,40800000	102.408,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1317305198 - Εκδότης: CARNIVAL CORP - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-NOV-15 - 07-NOV-22 Επιτόκιο: 1.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
PEPSICO INC 1/3/2023	1.000,0000	91,39130435	91.391,30
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US713448CG16 - Εκδότης: PEPSICO INC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-FEB-13 - 01-MAR-23 Επιτόκιο: 2.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
TEVA 31/3/203	2.000,0000	97,91500000	195.830,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1211040917 - Εκδότης: TEVA PHARM FNC NL II - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-MAR-15 - 31-MAR-23 Επιτόκιο: 1.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	26.800,0000	11,43693239	306.509,79
<ul style="list-style-type: none"> - 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	95,16300000	133.228,20
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
FERROVIAL EM. 15/7/2024	1.000,0000	107,58000000	107.580,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: ES0205032008 - Εκδότης: FERROVIAL SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-24 Επιτόκιο: 2.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB - Πρόσθετοι Όροι: 			

SOCIETE AUTOROUTES 15/1/2025	1.000,0000	107,91800000	107.918,00
- Isin: FR0012300812			
- Εκδότης: SOCIETE DES AUTOROUTES			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-NOV-14 - 15-JAN-25	Επιτόκιο: 1.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PROVINCE OF QUEBEC 15/1/2025	1.950,0000	101,76200000	198.435,90
- Isin: XS1167203881			
- Εκδότης: PROVINCE OF QUEBEC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JAN-15 - 15-JAN-25	Επιτόκιο: .875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CITIGROUP 28/1/2025	2.500,0000	101,50600000	253.765,00
- Isin: XS1173792059			
- Εκδότης: CITIGROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 28-JAN-25	Επιτόκιο: 1.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
WELL FARGO 2/6/2025	1.500,0000	103,18700000	154.780,50
- Isin: XS1240964483			
- Εκδότης: WELLS FARGO & COMPANY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-JUN-15 - 02-JUN-25	Επιτόκιο: 1.625%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BUONI POLIENALI DEL TES 01/12/2025	2.500,0000	107,10600000	267.765,00
- Isin: IT0005127086			
- Εκδότης: BUONI POLIENALI DEL TES			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-SEP-15 - 01-DEC-25	Επιτόκιο: 2%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2u			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.002.029,48
ΣΥΝΟΛΟ II.1			4.002.029,48
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	3.157,5000	75,80064431	239.340,53
- Isin: GB00BBHXPS12			
- 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			239.340,53
ΣΥΝΟΛΟ II.2			239.340,53
3. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			40.675,35
MARGIN IN USD/BETA	21.487,5000	0,87834870	18.873,52
ΣΥΝΟΛΟ II.3			59.548,87
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ETFS PRECIOUS METALS	13.400,0000	14,48500000	194.099,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			194.099,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			4.495.017,88
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			5.925.193,15
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			135.844,25
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			6.061.037,40

III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EURO FX USD CURR FUT jun16	2,0000	1,14120000	250.592,89
ΣΥΝΟΛΟ III.1			250.592,89
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			250.592,89
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			250.592,89

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