

GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ HIGH YIELD

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			
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			294.573,23
CASH ACCOUNT IN USD	113.685,8500	0,87627059	99.619,57
ΣΥΝΟΛΟ I.1			394.192,80
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 9.25 19/1/2027	3.000,0000	108,30100000	324.903,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS PCL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27	Επιτόκιο: 9.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			324.903,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			324.903,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			719.095,80
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΓΕΔ			
FIXED			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	14.900,0000	27,22154255	405.600,98
- 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:			
INTL FINANCE 17/12/2018	230.000,0000	1,50366645	345.843,28
- 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:			
NORWEGIAN GOV 22/5/2019	26.000,0000	11,20965804	291.451,11
- 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:			
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-20	Επιτόκιο: 6%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	2.000,0000	91,92954784	183.859,10
- 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:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	3.000,0000	93,73817035	281.214,51

- Isin: US040114GW47			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-16 - 22-APR-21	Επιτόκιο: 6.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	3.000,0000	106,00600000	318.018,00
- Isin: XS1405774727			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-SEP-16 - 15-SEP-21	Επιτόκιο: 6.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- 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:			
CEMEX 11/01/2022 4.75%	2.000,0000	104,25000000	208.500,00
- Isin: XS1028946348			
- Εκδότης: CEMEX SAB DE CV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-SEP-14 - 11-JAN-22	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/1/2022	1.500,0000	99,69800000	149.547,00
- Isin: XS1503160225			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-22	Επιτόκιο: 3.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
DEHLI INT AIRPORT 3/2/2022	2.000,0000	93,83631265	187.672,63
- Isin: XS1165980274			
- Εκδότης: DELHI INTERNATIONAL AIRP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-15 - 03-FEB-22	Επιτόκιο: 6.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GASLOG 8.875 22/3/2022	1.000,0000	92,54293726	92.542,94
- Isin: USG37585AC37			
- Εκδότης: GASLOG LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-17 - 22-MAR-22	Επιτόκιο: 8.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BRF 3/6/2022	2.000,0000	100,77300000	201.546,00
- 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: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SYSTEMS SUNLIGHT ABEE 20/6/2022	1.350,0000	100,65000000	135.877,50
- 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%	2.190,0000	100,31000000	219.678,90
- 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:			
SBERBANK OF RUSSIA 29/10/2022	2.000,0000	90,36978619	180.739,57
- Isin: XS0848530977			
- Εκδότης: SBERBANK (SB CAP SA)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 29-OCT-12 - 29-OCT-22	Επιτόκιο: 5.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS ARGENTINA 21/7/2023	1.000,0000	92,44567122	92.445,67
- Isin: USP7873PAE62			
- Εκδότης: PETROBRAS ARGENTINA SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUL-16 - 21-JUL-23	Επιτόκιο: 7.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALLOUREC SA 30/9/2024	2.000,0000	79,47100000	158.942,00
- Isin: FR0012188456			
- Εκδότης: VALLOUREC SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-SEP-14 - 30-SEP-24	Επιτόκιο: 2.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS 4.75% 14/01/2025	2.000,0000	102,28200000	204.564,00
- Isin: XS0982711714			
- Εκδότης: PETROBRAS GLOBAL FINANCE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JAN-14 - 14-JAN-25	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PORTEL4.5% 16/06/2025	1.500,0000	34,00000000	51.000,00
- Isin: XS0221854200			
- Εκδότης: PORTUGAL TELECOM INT FIN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-JUN-05 - 16-JUN-25	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SIGMA ALIMENTOS 2/5/2026	2.000,0000	88,81878724	177.637,57
- Isin: USP8674JAE93			
- Εκδότης: SIGMA ALIMENTOS SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-MAY-16 - 02-MAY-26	Επιτόκιο: 4.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- 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:			
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 10/2/2027	2.000,0000	107,44100000	214.882,00
- 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:			
ECOPETROL SA 18/9/2043	1.200,0000	94,63634770	113.563,62
- Isin: US279158AE95			
- Εκδότης: ECOPETROL SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-SEP-13 - 18-SEP-43	Επιτόκιο: 7.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.708.790,38
FLOATING			
GOLDMAN SACHS 15/11/2021	2.000,0000	88,42271293	176.845,43
- 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	2.000,0000	94,53645286	189.072,91
- 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			365.918,34
ZERO COUPON			
GTB 0 08/09/17	2.000,0000	99,57900000	199.158,00
- 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:			
GTB 0 15/9/17	1.000,0000	99,53400000	99.534,00
- Isin: GR0000168717			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-JUN-17 - 15-SEP-17	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			298.692,00
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	3.000,0000	93,44900000	280.347,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27	Επιτόκιο: 5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			

GGB 3% 24/2/27	4.000,0000	88,11500000	352.460,00
- Isin: GR0128014710			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-27 Επιτόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GGB 3% 24/02/2037	3.000,0000	73,09300000	219.279,00
- Isin: GR0138009759			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-37 Επιτόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			852.086,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			6.225.486,72
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	9.281,6140	46,62000000	432.708,84
- 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	915,0000	100,00000000	91.500,00
- 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			524.208,84
ΣΥΝΟΛΟ II.2			524.208,84
3. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			59.113,27
MARGIN IN USD/BETA	188.416,6600	0,87627059	165.103,98
ΣΥΝΟΛΟ II.3			224.217,25
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	9.840,0000	24,73273747	243.370,14
ΣΥΝΟΛΟ II.4			243.370,14
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			7.217.282,95
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			7.936.378,75
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			306.046,42
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			8.242.425,17
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON CURRENCY			
EURO FX USD CURR FUT SEP17	17,0000	1,14670000	2.135.241,41
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			2.135.241,41
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			2.135.241,41
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			2.135.241,41

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