

GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ HIGH YIELD

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 USD	11.318,8100	0,90073861	10.195,29
CASH ACCOUNT IN NOK	117.955,4800	0,10751763	12.682,29
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.744.570,05
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			499.970,00
CASH ACCOUNT IN GBP	33.196,5200	1,20992136	40.165,18
ΣΥΝΟΛΟ I.1			2.307.582,81
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	2.000,0000	106,55650000	213.113,00
- Isin: XS0483954144			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-10 - 03-FEB-20 Επιτόκιο: 4.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	5.000,0000	102,61250000	513.062,50
- 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:			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	2.000,0000	99,39500000	198.790,00
- Isin: CY0146250812			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-23 Επιτόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	5.000,0000	103,49450000	517.472,50
- 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			1.442.438,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			1.442.438,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			
			3.750.020,81
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΑ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	2.100,0000	100,00000000	210.000,00
- 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	106,31400000	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: 			
BANCO DO BRAZIL, 25/7/2018 3.75%	1.000,0000	100,12500000	100.125,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0955552178 - Εκδότης: BANCO DO BRASIL - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUL-13 - 25-JUL-18 Επιτόκιο: 3.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB - Πρόσθετοι Όροι: 			
PFOURS 5.25 1/2/2019	3.000,0000	102,12500000	306.375,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0982710153 - Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-FEB-19 Επιτόκιο: 5.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
MOTOR OIL FINANCE 5.125 15/5/2019	3.000,0000	101,16100000	303.483,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1066486629 - Εκδότης: MOTOR OIL FINANCE PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-14 - 15-MAY-19 Επιτόκιο: 5.125% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA - Πρόσθετοι Όροι: 			
PIRELLI INT 18/11/2019	2.000,0000	99,63600000	199.272,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	5.000,0000	100,69200000	503.460,00
<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: 			
OFFICE DEPOT MEX 20/9/2020	2.000,0000	94,12718429	188.254,37
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US67621PAA03 - Εκδότης: OFFICE DEPOT DE MEXICO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-SEP-13 - 20-SEP-20 Επιτόκιο: 6.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB+ - Πρόσθετοι Όροι: 			
CABLE COMM 7.5 1/11/2020	2.000,0000	104,50000000	209.000,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0954673777 - Εκδότης: CABLE COMM SYST NV - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-13 - 01-NOV-20 Επιτόκιο: 7.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ANADARKO PETR. 15/3/2021	3.200,0000	95,47739146	305.527,65
<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: 			

PIAGIM 4.625 30/4/2021 - Isin: XS1061086846 - Εκδότης: PIAGGIO & C SPA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-14 - 30-APR-21 Επιτόκιο: 4.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1 - Πρόσθετοι Όροι:	3.000,0000	102,87500000	308.625,00
BHARTI 3.375 20/05/21 - 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:	2.000,0000	107,89400000	215.788,00
THOMAS COOK 15/6/2021 - Isin: XS1172436211 - Εκδότης: THOMAS COOK FINANCE PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-JAN-15 - 15-JUN-21 Επιτόκιο: 6.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B - Πρόσθετοι Όροι:	2.000,0000	92,37500000	184.750,00
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022 - 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:	18.000,0000	11,01432135	198.257,78
MMC NORLISK NICKEL 14/10/2022 - Isin: XS1298447019 - Εκδότης: MMC NORILSK NICK VIA MMC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-15 - 14-OCT-22 Επιτόκιο: 6.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι:	2.000,0000	99,86939290	199.738,79
ABXCN 4.1% 1/5/2023 - 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:	2.000,0000	95,15402630	190.308,05
NORWEGIAN GOV 24/5/2023 - 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:	44.100,0000	11,62459143	512.644,48
PORTEL4.5% 16/06/2025 - Isin: XS0221854200 - Εκδότης: PORTUGAL TELECOM INT FIN - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-JUN-05 - 16-JUN-25 Επιτόκιο: 4.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C - Πρόσθετοι Όροι:	1.500,0000	15,12500000	22.687,50
TELECOM ITALIA 24/1/2033 - Isin: XS0161100515 - Εκδότης: TELECOM ITALIA FIN SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-JAN-03 - 24-JAN-33 Επιτόκιο: 7.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι:	2.000,0000	133,25000000	266.500,00
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.637.424,62
ΣΥΝΟΛΟ II.1			4.637.424,62

2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	7.367,5000	90,74410163	668.557,17
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληττική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			668.557,17
ΣΥΝΟΛΟ II.2			668.557,17
3. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			25.280,02
MARGIN IN GBP/BETA	43.237,5000	1,20992136	52.313,97
ΣΥΝΟΛΟ II.3			77.593,99
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ISHARES SILVER TRUST	12.650,0000	16,09169519	203.559,94
ETFS PRECIOUS METALS	30.000,0000	16,33500000	490.050,00
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	7.760,0000	51,30000000	398.088,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			1.091.697,94
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			6.475.273,72
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			10.225.294,53
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			113.004,31
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			10.338.298,84
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EURO FX GBP CURR sep16	6,0000	0,83845000	760.843,92
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			760.843,92
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			760.843,92
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			760.843,92

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