

GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ HIGH YIELD

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ		ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ				
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO				1.549.297,53
CASH ACCOUNT IN USD	9.304,3500	0,89261805		8.305,23
ΣΥΝΟΛΟ I.1				1.557.602,76
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ				
FIXED				
CYPRUS 4.75 25/6/2019	4.500,0000	106,29750000		478.338,75
- Isin: XS1081101807				
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUN-14 - 25-JUN-19 Επιτόκιο: 4.75%				
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG				
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-				
- Πρόσθετοι Όροι:				
CYPRUS 4.625 3/2/2020	2.000,0000	106,21350000		212.427,00
- 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	101,92050000		509.602,50
- 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:				
ΣΥΝΟΛΟ FIXED				1.200.368,25
ZERO COUPON				
CYPRUS TBILL 06/11/2015	5.000,0000	99,71250000		498.562,50
- Isin: CY0145890816				
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-AUG-15 - 06-NOV-15 Επιτόκιο: 0%				
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG				
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:				
- Πρόσθετοι Όροι:				
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON				498.562,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2				1.698.930,75
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)				
				3.256.533,51
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ				
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX				53.741,58
MARGIN IN USD/BETA	23.532,5500	0,89261805		21.005,58
ΣΥΝΟΛΟ II.1				74.747,16
2. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ				
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	104,75600000	209.512,00
<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: 			
LUKOIL INTL 24/4/2018	2.000,0000	85,91448719	171.828,97
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0919502434 - Εκδότης: LUKOIL INTL FINANCE BV - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-13 - 24-APR-18 Επιτόκιο: 3.416% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Bα1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
FRIGOGLASS 8,25% 15/05/2018	4.000,0000	98,54300000	394.172,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0932291007 - Εκδότης: FRIGOGLASS FINANCE BV - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-13 - 15-MAY-18 Επιτόκιο: 8.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+ - Πρόσθετοι Όροι: 			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	7.367,5000	135,40961408	997.630,33
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: GB00BBHXP512 - Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A - Πρόσθετοι Όροι: 			
BGB 1.25 22/6/2018	6.000,0000	103,81600000	622.896,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: BE0000329384 - Εκδότης: BELGIUM KINGDOM - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-FEB-13 - 22-JUN-18 Επιτόκιο: 1.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: AA - Πρόσθετοι Όροι: 			
EUROBANK HELLAS PLC 26/06/2018	1.000,0000	36,65400000	36.654,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1081588086 - Εκδότης: ERB HELLAS PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 26-JUN-18 Επιτόκιο: 4.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C - Πρόσθετοι Όροι: 			
PFOURS 5.25 1/2/2019	3.000,0000	101,62500000	304.875,00
<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: 			
PPC FINANCE 1/5/2019	2.000,0000	81,36400000	162.728,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1063837741 - Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19 Επιτόκιο: 5.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC- - Πρόσθετοι Όροι: 			
MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019	3.000,0000	94,85400000	284.562,00
<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: 			

GOBAIN 5.625 15/5/2019	2.000,0000	98,00000000	196.000,00
- Isin: XS1028957469			
- Εκδότης: SGD GROUP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-14 - 15-MAY-19 Επιτόκιο: 5.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTERNATIONAL GAME TECH	1.000,0000	100,00000000	100.000,00
- Isin: XS0860855930			
- Εκδότης: INTERNATIONAL GAME TECH			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-12 - 05-MAR-20 Επιτόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OFFICE DEPOT MEX 20/9/2020	2.000,0000	89,26180487	178.523,61
- 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	103,25000000	206.500,00
- 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:			
OI EUROPEAN GROUP BV	1.000,0000	104,87500000	104.875,00
- Isin: XS0908230781			
- Εκδότης: OI EUROPEAN GROUP BV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-13 - 31-MAR-21 Επιτόκιο: 4.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIAGIM 4.625 30/4/2021	3.000,0000	100,87500000	302.625,00
- 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:			
INTRALOT CAPITAL 15/5/2021	2.000,0000	87,46500000	174.930,00
- Isin: XS1064899120			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 15-MAY-21 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BHARTI 3.375 20/05/21	2.000,0000	103,93300000	207.866,00
- 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:			
THOMAS COOK 15/6/2021	3.000,0000	103,62500000	310.875,00
- 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:			

GM 4.375 25/9/2021	1.000,0000	91,04704097	91.047,04
- Isin: US37045XAAQ97			
- Εκδότης: GENERAL MOTORS FINL CO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-SEP-14 - 25-SEP-21 Επιτόκιο: 4.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VESTAS WIND 11/3/2022	3.000,0000	97,02200000	291.066,00
- 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:			
BRF 3/6/2022	2.000,0000	85,13800000	170.276,00
- 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: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FIAT 4.75 15/07/22	1.500,0000	99,75000000	149.625,00
- Isin: XS1088515207			
- Εκδότης: FIAT CHRYSLER FINANCE EU			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-22 Επιτόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			5.879.066,95
ΣΥΝΟΛΟ II.2			5.879.066,95
3. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
MIKRO KAPITAL SARL 10/12/2015	5.000,0000	100,00000000	500.000,00
- Isin: XS1075048691			
- Εκδότης: MIKRO KAPITAL SARL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-JUN-14 - 09-DEC-15 Επιτόκιο: 8.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			500.000,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			500.000,00
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
DB X TRACKERS SHORTDAX ETF	8.495,0000	30,83000000	261.900,85
ETFS SHORT AUD LONG USD	10.680,0000	41,83700794	446.819,24
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	5.140,0000	52,88000000	271.803,20
ΣΥΝΟΛΟ II.4			980.523,29
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			7.434.337,40
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			10.690.870,91
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			57.408,40
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			10.748.279,31

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