

GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ HIGH YIELD

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ		ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ				
CASH ACCOUNT IN NOK	6.419,9300		0,10413412	668,53
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO				842.068,61
CASH ACCOUNT IN USD	3.885,8800		0,91852668	3.569,28
ΣΥΝΟΛΟ I.1				846.306,42
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ				
FIXED				
CYPRUS 4.625 3/2/2020	2.000,0000		108,15350000	216.307,00
- 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		104,18550000	520.927,50
- 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:				
REP OF CYPRUS 4/11/2025	9.500,0000		104,57700000	993.481,50
- 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				1.730.716,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2				1.730.716,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)				2.577.022,42
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ				
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX				53.741,58
ΣΥΝΟΛΟ II.1				53.741,58
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		106,37900000	212.758,00
- 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:				

LUKOIL INTL 24/4/2018	2.000,0000	89,44153578	178.883,07
- 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: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FRIGOGLASS 8,25% 15/05/2018	2.000,0000	96,40600000	192.812,00
- 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:			
BGB 1.25 22/6/2018	6.000,0000	103,81800000	622.908,00
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	3.000,0000	102,25000000	306.750,00
- 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	81,71100000	163.422,00
- 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:			
GOBAIN 5.625 15/5/2019	2.000,0000	102,00000000	204.000,00
- 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:			
MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019	3.000,0000	96,90000000	290.700,00
- 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:			
HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19	3.000,0000	88,43000000	265.290,00
- Isin: XS1083287547			
- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JUL-14 - 04-JUL-19 Επιτόκιο: 5.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIRELLI INT 18/11/2019	2.000,0000	98,62600000	197.252,00
- 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:			

OTE PLC 4.375% 02/12/2019	4.000,0000	99,09200000	396.368,00
- 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:			
INTERNATIONAL GAME TECH	1.000,0000	101,00000000	101.000,00
- 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:			
GAZPROM 3.389% 20/03/2020	2.500,0000	95,87500000	239.687,50
- Isin: XS0906946008			
- Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-13 - 20-MAR-20 Επιτόκιο: 3.389%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OFFICE DEPOT MEX 20/9/2020	2.000,0000	92,54156333	185.083,13
- 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	105,75000000	211.500,00
- 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	108,62500000	108.625,00
- 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	102,12500000	306.375,00
- 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	88,67800000	177.356,00
- Isin: XS1064899120			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 15-MAY-21 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BHARTI 3.375 20/05/21	2.000,0000	104,28700000	208.574,00
- 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	104,12500000	312.375,00
- 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:			
VESTAS WIND 11/3/2022	3.000,0000	98,91800000	296.754,00
- 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	3.000,0000	91,76500000	275.295,00
- 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: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FIAT 4.75 15/07/22	1.500,0000	107,00000000	160.500,00
- 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:			
MMC NORILSK NICKEL 14/10/2022	2.000,0000	93,57490585	187.149,81
- 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:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	25.700,0000	10,93918567	281.137,07
- 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:			
SPGB 5.15 31/10/2044	1.000,0000	141,81900000	141.819,00
- Isin: ES00000124H4			
- Εκδότης: BONOS Y OBLIG DEL ESTADO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-OCT-13 - 31-OCT-44 Επιτόκιο: 5.15%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			6.434.373,58
ΣΥΝΟΛΟ II.2			6.434.373,58
3. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	7.367,5000	102,18679747	752.861,23
- 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			752.861,23
ΣΥΝΟΛΟ II.3			752.861,23

4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	23.532,5500	0,91852668	21.615,28
ΣΥΝΟΛΟ II.4			21.615,28
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	10.250,0000	51,06000000	523.365,00
ΣΥΝΟΛΟ II.5			523.365,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			7.785.956,67
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			10.362.979,09
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-227.004,26
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			10.135.974,83

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