

GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ HIGH YIELD

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN CAD	10.251,1200	0,70482098	7.225,20
CASH ACCOUNT IN AUD	11.620,5300	0,68511921	7.961,45
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			936.669,20
CASH ACCOUNT IN RUB	1.325.900,3200	0,01555210	20.620,53
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			399.830,00
CASH ACCOUNT IN USD	18.299,5900	0,94867660	17.360,39
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.389.666,77
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 06/5/2022	2.000,0000	104,28400000	208.568,00
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	2.000,0000	101,87450000	203.749,00
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.75 26/7/2023	2.500,0000	102,44800000	256.120,00
- Isin: XS1457553367			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUL-16 - 26-JUL-23 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.000,0000	105,69450000	211.389,00
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			879.826,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			879.826,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.269.492,77
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	1.960,0000	68,97437654	135.189,78
- Isin: AU3CB0197572			
- Εκδότης: EXPORT DEVELOPMNT CANADA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-AUG-12 - 08-AUG-17 Επιτόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			

INTL FINANCE 17/12/2018	120.000,0000	1,58363919	190.036,70
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	3.000,0000	101,75000000	305.250,00
- 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	86,68200000	173.364,00
- 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:			
CSN ISLANDS 21/9/2019	1.000,0000	74,35252822	74.352,53
- Isin: USG2583XAA93			
- Εκδότης: CSN ISLANDS XI CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-SEP-09 - 21-SEP-19 Επιτόκιο: 6.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FORD MOTOER 2/6/2020	4.000,0000	68,64209372	274.568,37
- Isin: XS1423777561			
- Εκδότης: FORD MOTOR CREDIT CO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-JUN-16 - 02-JUN-20 Επιτόκιο: 3.588%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- 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:			
ASTALDI SPA, 1/12/2020	2.000,0000	104,50000000	209.000,00
- Isin: XS1000393899			
- Εκδότης: ASTALDI SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-DEC-13 - 01-DEC-20 Επιτόκιο: 7.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	2.000,0000	97,47652025	194.953,04
- Isin: USG3925DAA84			
- Εκδότης: GERDAU TRADE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21 Επιτόκιο: 5.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	3.000,0000	101,30158429	303.904,75
- Isin: USP04808AA23			
- 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	4.000,0000	101,45000000	405.800,00
- 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	3.000,0000	99,56500000	298.695,00
- 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:			
TORONTO DOM 22/12/2021	4.400,0000	72,41119256	318.609,25
- Isin: CA8911452R48			
- Εκδότης: TORONTO-DOMINION BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-DEC-14 - 22-DEC-21 Επιτόκιο: 2.621%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CEMEX 11/01/2022 4.75%	2.000,0000	103,87500000	207.750,00
- 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: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
DEHLI INT AIRPORT 3/2/2022	2.000,0000	100,32255004	200.645,10
- Isin: XS1165980274			
- Εκδότης: DELHI INTERNATIONAL AIRPORT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-15 - 03-FEB-22 Επιτόκιο: 6.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SBERBANK OF RUSSIA 29/10/2022	2.000,0000	96,29067451	192.581,35
- Isin: XS0848530977			
- Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 29-OCT-12 - 29-OCT-22 Επιτόκιο: 5.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NOVATEK 13/12/2022	2.000,0000	93,91898302	187.837,97
- Isin: XS0864383723			
- Εκδότης: NOVATEK FIN LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-12 - 13-DEC-22 Επιτόκιο: 4.422%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALE 3.75% 10/1/2023	2.000,0000	105,25000000	210.500,00
- Isin: XS0802953165			
- Εκδότης: VALE OVERSEAS LIMITED			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-JUL-12 - 10-JAN-23 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALLOUREC SA 30/9/2024	2.000,0000	79,75000000	159.500,00
- 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:			

PORTEL4.5% 16/06/2025 - 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:	1.500,0000	30,50000000	45.750,00
REPUBLIC OF COLOMBIA 22/3/2026 - Isin: XS1385239006 - Εκδότης: REPUBLIC OF COLOMBIA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-16 - 22-MAR-26 Επιτόκιο: 3.875% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι:	2.000,0000	110,63300000	221.266,00
SIGMA ALIMENTOS 2/5/2026 - 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:	2.000,0000	90,14894223	180.297,88
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028 - Isin: XS1432493440 - Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JUN-16 - 14-JUN-28 Επιτόκιο: 3.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι:	3.000,0000	102,01500000	306.045,00
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.970.896,72
FLOATING			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022 - Isin: US71656MBN83 - Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 4.6065% - Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι:	2.000,0000	97,57707997	195.154,16
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			195.154,16
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027 - 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: B3e - Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE	2.000,0000	88,27600000	176.552,00
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			176.552,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			5.342.602,88
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018 - Isin: GB00BBHXPS12 - Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 6% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A - Πρόσθετοι Όροι:	8.756,2396	49,42000000	432.733,36

CELTONA LTD 15/12/2019	915,0000	100,0000000	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			524.233,36
ΣΥΝΟΛΟ II.2			524.233,36
3. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			63.290,57
MARGIN IN USD/BETA	48.682,8500	0,94867660	46.184,28
ΣΥΝΟΛΟ II.3			109.474,85
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	13.840,0000	27,57793378	381.678,60
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	19.450,0000	16,81000000	326.954,50
ΣΥΝΟΛΟ II.4			708.633,10
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			6.684.944,19
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			8.954.436,96
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			61.062,60
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			9.015.499,56
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES			
EURO-BUND FUT MAR 17	4,0000	164,15000000	656.600,00
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT			Χώρα: GERMANY
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			656.600,00
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			656.600,00
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			656.600,00

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