

**GMM ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Α/Κ HIGH YIELD**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016**

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN NOK	1.162,4600	0,10621913	123,48
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.209.875,02
CASH ACCOUNT IN USD	214.862,2000	0,87834870	188.723,94
CASH ACCOUNT IN GBP	33.196,5200	1,26334407	41.938,63
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>1.440.661,07</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	2.000,0000	105,70400000	211.408,00
- 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	102,42250000	512.112,50
- 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	97,78200000	195.564,00
- 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	9.500,0000	103,21850000	980.575,75
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>1.899.660,25</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>1.899.660,25</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>3.340.321,32</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
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	106,98000000	213.960,00
- 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:			

<b>PFOURS 5.25 1/2/2019</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>102,50000000</b>	<b>307.500,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS0982710153</li> <li>- Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-FEB-19 Επιτόκιο: 5.25%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>99,08000000</b>	<b>297.240,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1066486629</li> <li>- Εκδότης: MOTOR OIL FINANCE PLC</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-14 - 15-MAY-19 Επιτόκιο: 5.125%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>87,89500000</b>	<b>263.685,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1083287547</li> <li>- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JUL-14 - 04-JUL-19 Επιτόκιο: 5.25%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>VALLOUREC SA 2/8/2019</b>	<b>2.000,0000</b>	<b>85,25000000</b>	<b>170.500,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: FR0011302793</li> <li>- Εκδότης: VALLOUREC SA</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-AUG-12 - 02-AUG-19 Επιτόκιο: 3.25%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019</b>	<b>2.000,0000</b>	<b>100,25000000</b>	<b>200.500,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1082459568</li> <li>- Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 15-NOV-19 Επιτόκιο: 3.3524%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>PIRELLI INT 18/11/2019</b>	<b>2.000,0000</b>	<b>97,03300000</b>	<b>194.066,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1139287350</li> <li>- Εκδότης: PIRELLI INTERNATIONAL</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-NOV-14 - 18-NOV-19 Επιτόκιο: 1.75%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>OTE PLC 4.375% 02/12/2019</b>	<b>5.000,0000</b>	<b>99,38700000</b>	<b>496.935,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1327539976</li> <li>- Εκδότης: OTE PLC</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-15 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: 4.375%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>INTERNATIONAL GAME TECH</b>	<b>1.000,0000</b>	<b>103,62500000</b>	<b>103.625,00</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS0860855930</li> <li>- Εκδότης: INTERNATIONAL GAME TECH</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-12 - 05-MAR-20 Επιτόκιο: 4.75%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>GAZPROM 3.389% 20/03/2020</b>	<b>2.500,0000</b>	<b>99,87500000</b>	<b>249.687,50</b>
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS0906946008</li> <li>- Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA)</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-13 - 20-MAR-20 Επιτόκιο: 3.389%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			

<b>OFFICE DEPOT MEX 20/9/2020</b>	2.000,0000	89,81115503	179.622,31
- 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:			
<b>CABLE COMM 7.5 1/11/2020</b>	2.000,0000	106,50000000	213.000,00
- 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:			
<b>OI EUROPEAN GROUP BV</b>	1.000,0000	109,25000000	109.250,00
- 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:			
<b>PIAGIM 4.625 30/4/2021</b>	3.000,0000	103,62500000	310.875,00
- 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:			
<b>BHARTI 3.375 20/05/21</b>	2.000,0000	106,90800000	213.816,00
- 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:			
<b>THOMAS COOK 15/6/2021</b>	2.000,0000	100,50000000	201.000,00
- 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:			
<b>VESTAS WIND 11/3/2022</b>	3.000,0000	101,09800000	303.294,00
- 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:			
<b>BRF 3/6/2022</b>	3.000,0000	92,59700000	277.791,00
- 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:			
<b>FIAT 4.75 15/07/22</b>	2.000,0000	107,37500000	214.750,00
- 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 NORLISK NICKEL 14/10/2022	2.000,0000	92,00702679	184.014,05
- 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	44.100,0000	11,43693239	504.368,72
- 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:			
PORTEL4.5% 16/06/2025	1.500,0000	23,87500000	35.812,50
- 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: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>5.455.292,08</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.1</b>			<b>5.455.292,08</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	7.367,5000	75,80064431	558.461,25
- Isin: GB00BBHXP512			
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>558.461,25</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>558.461,25</b>
<b>3. MARGIN</b>			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			45.099,59
MARGIN IN USD/BETA	45.643,3000	0,87834870	40.090,73
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>85.190,32</b>
<b>4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ</b>			
ETFS PRECIOUS METALS	20.000,0000	14,48500000	289.700,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.4</b>			<b>289.700,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)</b>			<b>6.388.643,65</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)</b>			<b>9.728.964,97</b>
<b>ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>248.870,53</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>9.977.835,50</b>
<b>III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY</b>			
EURO FX USD CURR FUT jun16	5,0000	1,14120000	626.482,21
<b>ΣΥΝΟΛΟ III.1</b>			<b>626.482,21</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)</b>			<b>626.482,21</b>
<b>ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)</b>			<b>626.482,21</b>

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