

GMM KOLONA BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016
Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN AUD	4.865,8700	0,68226786	3.319,83
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			23.156,39
CASH ACCOUNT IN GBP	2.941,0900	1,16139972	3.415,78
ΣΥΝΟΛΟ I.1			29.892,00
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 06/5/2022	1.000,0000	104,31350000	104.313,50
- 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	1.000,0000	106,45650000	106.456,50
- 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			210.770,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			210.770,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			240.662,00
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	1.050,0000	100,00000000	105.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17			Επιτόκιο: 6%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PPC FINANCE 1/5/2019	1.000,0000	82,19800000	82.198,00
- 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:			
HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19	1.000,0000	101,04500000	101.045,00
- 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:			
FORD MOTOER 2/6/2020	1.300,0000	69,56812445	90.438,56
- 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:			

REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	97,57279814	146.359,20
- 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:			
EMPRESA 5.15 15/06/2022	700,0000	95,04435086	66.531,05
- Isin: US29082AAA51			
- Εκδότης: EMPRESA BRAS DE AERONAU			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUN-12 - 15-JUN-22 Επιτόκιο: 5.15%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROLEOS MEXICANOS 30/1/2023	750,0000	84,61069797	63.458,02
- Isin: US71654QBG64			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-JUL-13 - 30-JAN-23 Επιτόκιο: 3.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ECOPETROL SA 18/9/2043	610,0000	94,81139683	57.834,95
- Isin: US279158AE95			
- Εκδότης: ECOPETROL SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-SEP-13 - 18-SEP-43 Επιτόκιο: 7.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			712.864,78
STEPPED			
GGB 3% 24/2/26	1.000,0000	70,44000000	70.440,00
- Isin: GR0128013704			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-26 Επιτόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			70.440,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			783.304,78
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	58,06998595	30.559,33
- 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			30.559,33
ΣΥΝΟΛΟ II.2			30.559,33
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	15.000,0000	0,13400000	2.010,00
PUBLIC POWER CORP.	1.940,0000	2,65000000	5.141,00
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	1.220,0000	7,52000000	9.174,40
EUROBANK	80.121,0000	0,50800000	40.701,47
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	1.340,0000	14,31771347	19.185,74
LUKOIL PJSC-SPON ADR	520,0000	43,62512320	22.685,06
ΤΡΑΠΕΖΑ ALPHA BANK	16.700,0000	1,48000000	24.716,00
TERNA ENERGY SA	3.570,0000	2,58000000	9.210,60
ΣΥΝΟΛΟ II.3			132.824,27

4. MARGIN

MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			134,43
MARGIN IN USD/BETA	9.564,2500	0,89597706	8.569,35
ΣΥΝΟΛΟ II.4			8.703,78

5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

MORGAN STANLEY CHINA A	1.100,0000	16,75477108	18.430,25
ISHARES EM ASIA MLCL GOV BND	685,0000	85,84000000	58.800,40
DBX STX EUROPE BANKS SHORT	2.150,0000	22,05000000	47.407,50

ΣΥΝΟΛΟ II.5

ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.080.030,31
--	--	--	---------------------

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.320.692,31
---------------------------------	--	--	---------------------

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			23.951,15
			1.344.643,46

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES ON STOCKS

E-MINI SILVER FUT DEC16	3,0000	19,21250000	129.104,69
-------------------------	--------	-------------	------------

- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

			129.104,69
--	--	--	-------------------

2. OPTIONS ON STOCKS

OPTION PUT MINI 1990 SP 1216	2,0000	17,00000000	1.523,16
------------------------------	--------	-------------	----------

- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES

ΣΥΝΟΛΟ IV.2

			1.523,16
--	--	--	-----------------

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

			130.627,85
--	--	--	-------------------

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

			130.627,85
--	--	--	-------------------

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