

GMM NAVIGATOR WORLD BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ		ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ				
CASH ACCOUNT IN AUD	0,0800	0,67535625		0,05
CASH ACCOUNT IN NOK	865,7400	0,10621913		91,96
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO				635.303,30
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO				201,91
CASH ACCOUNT IN GBP	11.871,7100	1,26334407		14.998,05
CASH ACCOUNT IN USD	4.306,2500	0,87834870		3.782,39
ΣΥΝΟΛΟ I.1				654.377,66
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ				
FIXED				
CYPRUS 2 18/1/2018	930,0000	98,45500000		91.563,15
- Isin: CY0146220815				
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18 Επιτόκιο: 2%				
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG				
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-				
- Πρόσθετοι Όροι:				
CYPRUS 06/5/2022	2.000,0000	102,42250000		204.845,00
- 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: 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	3.000,0000	103,21850000		309.655,50
- 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				801.627,65
ΣΥΝΟΛΟ I.2				801.627,65
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)				1.456.005,31
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- 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:				

BGB 1.25 22/6/2018	4.000,0000	103,80400000	415.216,00
<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: 			
PFOURS 5.25 1/2/2019	1.500,0000	102,50000000	153.750,00
<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: 			
MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019	1.000,0000	99,08000000	99.080,00
<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: 			
VALLOUREC SA 2/8/2019	1.000,0000	85,25000000	85.250,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: FR0011302793 - Εκδότης: VALLOUREC SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-AUG-12 - 02-AUG-19 Επιτόκιο: 3.25% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB- - Πρόσθετοι Όροι: 			
SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019	1.000,0000	100,25000000	100.250,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1082459568 - Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 15-NOV-19 Επιτόκιο: 3.3524% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
PIRELLI INT 18/11/2019	1.000,0000	97,03300000	97.033,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	1.000,0000	99,38700000	99.387,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL 02/12/2019	1.000,0000	102,10100000	102.101,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1147600305 - Εκδότης: GLAXOSMITHKLINE CAPITAL - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-14 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: .625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GAZPROM 3.389% 20/03/2020	1.000,0000	99,87500000	99.875,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			

BHARTI 3.375 20/05/21	1.000,0000	106,90800000	106.908,00
- 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:			
GM 4.375 25/9/2021	1.000,0000	90,68950373	90.689,50
- Isin: US37045XAQ97			
- 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	1.000,0000	101,09800000	101.098,00
- 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:			
CARNIVAL CORP 7/11/2022	1.000,0000	102,40800000	102.408,00
- Isin: XS1317305198			
- Εκδότης: CARNIVAL CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-NOV-15 - 07-NOV-22 Επιτόκιο: 1.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GOLDMAN SACHS 22/1/2023	1.000,0000	90,70531401	90.705,31
- Isin: US38141GRD87			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JAN-13 - 22-JAN-23 Επιτόκιο: 3.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	18.500,0000	11,43693239	211.583,25
- 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:			
FERROVIAL EM. 15/7/2024	1.000,0000	107,58000000	107.580,00
- Isin: ES0205032008			
- Εκδότης: FERROVIAL SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-24 Επιτόκιο: 2.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CITIGROUP 28/1/2025	1.000,0000	101,50600000	101.506,00
- Isin: XS1173792059			
- Εκδότης: CITIGROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 28-JAN-25 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			2.374.420,06
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.374.420,06

2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.631,2500	75,80064431	199.450,45
- 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			199.450,45
ΣΥΝΟΛΟ II.2			199.450,45
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLOBO PLC -GBO LN	40.000,0000	0,01263344	505,34
ΣΥΝΟΛΟ II.3			505,34
4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	20.083,2400	0,87834870	17.640,09
ΣΥΝΟΛΟ II.4			17.640,09
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
DBX STX EUROPE BANKS SHORT	4.250,0000	23,92000000	101.660,00
ΣΥΝΟΛΟ II.5			101.660,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			2.693.675,94
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			4.149.681,25
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			42.768,00
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			4.192.449,25

III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EURO FX USD CURR FUT jun16	1,0000	1,14120000	125.296,44
EURO E-MINI CURR FUT JUN16	1,0000	1,14120000	62.648,22
ΣΥΝΟΛΟ III.1			187.944,66
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			187.944,66
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			187.944,66

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