

GMM ZEUS GLOBAL BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	3.732,8700	0,93536620	3.491,60
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			483.952,72
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			99.980,00
ΣΥΝΟΛΟ I.1			587.424,32
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.000,0000	107,21950000	214.439,00
- 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:			
CYPRUS 9.25 19/1/2027	1.000,0000	106,75000000	106.750,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27			Επιτόκιο: 9.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			321.189,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			321.189,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			908.613,32
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	1.500,0000	71,84451438	107.766,77
- 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	100.000,0000	1,68353423	168.353,42
- 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:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	1.000,0000	98,21345057	98.213,45
- Isin: USG3925DAA84			
- Εκδότης: GERDAU TRADE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21			Επιτόκιο: 5.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	100,45832944	150.687,49
- Isin: USPO4808AA23			
- 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	1.000,0000	102,71000000	102.710,00
- 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	1.000,0000	100,51900000	100.519,00
- 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	1.500,0000	72,48650543	108.729,76
- 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:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/1/2022	2.000,0000	99,23700000	198.474,00
- Isin: XS1503160225			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-22 Επιτόκιο: 3.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
DEHLI INT AIRPORT 3/2/2022	2.000,0000	100,66878683	201.337,57
- Isin: XS1165980274			
- Εκδότης: DELHI INTERNATIONAR AIRPORT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-15 - 03-FEB-22 Επιτόκιο: 6.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OPAP 21/3/2022	1.200,0000	100,66000000	120.792,00
- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22 Επιτόκιο: 3.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GASLOG 8.875 22/3/2022	1.000,0000	94,58890656	94.588,91
- Isin: USG37585AC37			
- Εκδότης: GASLOG LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-17 - 22-MAR-22 Επιτόκιο: 8.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BRF 3/6/2022	1.000,0000	99,57600000	99.576,00
- 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: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BANCO DO BRAZIL, 10/10/2022 3.875%	2.000,0000	89,79515480	179.590,31
- Isin: US05958AAJ79			
- Εκδότης: BANCO DO BRASIL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-APR-13 - 10-OCT-22 Επιτόκιο: 3.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SIGMA ALIMENTOS 7/2/2024	1.000,0000	102,65000000	102.650,00
- Isin: XS1562623584			
- Εκδότης: SIGMA ALIMENTOS SA			

- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-FEB-17 - 07-FEB-24	Επιτόκιο: 2.625%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS 4.75% 14/01/2025		1.000,0000	102,87500000
- Isin: XS0982711714			
- Εκδότης: PETROBRAS GLOBAL FINANCE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JAN-14 - 14-JAN-25	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ECOPETROL SA 18/9/2043		700,0000	100,07950613
- 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			2.006.919,33
FLOATING			
GOLDMAN SACHS 15/11/2021		1.000,0000	94,56832850
- Isin: US38145GAF72			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21	Επιτόκιο: 2.209%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022		1.000,0000	100,37788794
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.7696%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			194.946,22
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.201.865,55
2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLENCORE XSTRATA PLC	20.000,0000	3,66030414	73.206,08
ABB LTD-REG	4.600,0000	21,90538519	100.764,77
POSCO -SPON ADR	1.630,0000	60,33111963	98.339,73
NOVATEK OAO SPONS GDR	810,0000	116,45309139	94.327,00
ΣΥΝΟΛΟ II.2			366.637,58
3. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			21.661,01
MARGIN IN USD/BETA	32.140,0000	0,93536620	30.062,67
ΣΥΝΟΛΟ II.3			51.723,68
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ISHARES MSCI FRONTIER 100	3.000,0000	25,94705827	77.841,17
PROSHARES SHORT 7-10YR	6.900,0000	26,73276588	184.456,08
LYXOR ETF STOXX BANKS	4.800,0000	21,33500000	102.408,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			364.705,25
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			2.984.932,06
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			3.893.545,38
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-70.382,30
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			3.823.163,08
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON CURRENCY			
EUR FX USD FUT JUN17	10,0000	1,07220000	1.253.624,54
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE	Χώρα: UNITED STATES		
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			1.253.624,54



ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

1.253.624,54
1.253.624,54

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