

GMM DEVELOPMENT BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2018

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	92.577,8900	0,81162243	75.138,29
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			69,50
CASH ACCOUNT IN GBP	0,7200	1,14298777	0,82
EUROBANK CYPRUS CASH EURO			2.846,98
ΣΥΝΟΛΟ I.1			78.055,59
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.500,0000	110,56200000	165.843,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			165.843,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			165.843,00
3. ΛΟΙΠΟΙ ΟΡΓΑΝΙΣΜΟΙ ΣΥΛΛΟΓΙΚΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ			
HELLAS -CYPRUS GMM RECOVERY FUND	14.806,3330	9,76330000	144.558,67
ΣΥΝΟΛΟ I.3			144.558,67
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			388.457,26
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
HELLENIC TBILL 31/8/2018	500,0000	99,48900000	49.744,50
- Isin: GR0002173392			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-MAR-18 - 31-AUG-18			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
Q & R UK LTD 21/7/2020 6	1.500,0000	100,00000000	150.000,00
- 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:			
EUROPEAN INV 27/8/2021-zero cpn	2.000,0000	19,30529093	38.610,58
- Isin: XS1097534751			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-AUG-14 - 27-AUG-21			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GM 4.375 25/9/2021	400,0000	83,27327327	33.309,31
- 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: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF NIGERIA 27/6/2022	600,0000	82,87476666	49.724,86
- Isin: US65412AEK43			
- Εκδότης: REPUBLIC OF NIGERIA			

- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-JUN-17 - 27-JUN-22	Επιτόκιο: 5.625%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIRELLI INT 25/01/2023-ITALIAN		1.000,0000	98,21600000
- Isin: XS1757843146			
- Εκδότης: PIRELLI INTERNATIONAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JAN-18 - 25-JAN-23	Επιτόκιο: 1.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ALPHA BANK 2.5% 02/05/23 CORP		1.000,0000	99,93700000
- Isin: XS1762980065			
- Εκδότης: ALPHA BANK AE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-FEB-18 - 05-FEB-23	Επιτόκιο: 2.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3e			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS ARGENTINA 21/7/2023		300,0000	85,45816086
- Isin: USP7873PAE62			
- Εκδότης: PETROBRAS ARGENTINA SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUL-16 - 21-JUL-23	Επιτόκιο: 7.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2024		1.000,0000	100,25000000
- Isin: XS1685702794			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-SEP-17 - 15-SEP-24	Επιτόκιο: 5.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GENERALITAT DE CATALUNYA		1.000,0000	109,30400000
- Isin: ES0000095879			
- Εκδότης: SPAIN LETRAS DEL TESORO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-APR-05 - 26-APR-35	Επιτόκιο: 4.22%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GGB 4.0% 01/30/37		300,0000	89,32000000
- Isin: GR0133011248			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-17 - 30-JAN-37	Επιτόκιο: 4%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CHENIERE ENERGY 15/3/2045		800,0000	62,80009739
- Isin: US16411RAG48			
- Εκδότης: CHENIERE ENERGY INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-SEP-15 - 15-MAR-45	Επιτόκιο: 4.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			831.769,78
FLOATING			
SANTAN 0.983 PERP		600,0000	93,79800000
- Isin: XS0202197694			
- Εκδότης: BANCO SANTANDER SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-04 - 30-MAR-65	Επιτόκιο: 1.009%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			56.278,80
STEPPED			

REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	97,46200000	97.462,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νιά Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27 Επιτόκιο: 5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			97.462,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			985.510,58
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2021	3.314,8621	46,62000000	154.538,87
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νιά Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-21 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CELTONA LTD 15/12/2019	78,0000	100,00000000	7.800,00
- Isin:			
- Εκδότης: CELTONA LTD			
- Ην/νιά Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-16 - 15-DEC-19 Επιτόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			162.338,87
ΣΥΝΟΛΟ II.2			162.338,87
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
QUALITY & RELIABILITY SA	67.439,0000	0,27000000	18.208,53
ΣΥΝΟΛΟ II.3			18.208,53
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			34.863,39
MARGIN IN USD/BETA	25.729,8100	0,81162243	20.882,89
ΣΥΝΟΛΟ II.4			55.746,28
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.221.804,26
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.610.261,52
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-22.695,35
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.587.566,17
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. OPTIONS ON STOCKS			
OPTION DAX 21/09/18	10,0000	113,10000000	5.655,00
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT Χώρα: GERMANY			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			5.655,00
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			5.655,00
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			5.655,00

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