

**GMM HERMES BALANCED FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017**

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN USD	451.923,6200	0,87627059	396.007,38
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			155.798,07
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			39.225,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>591.030,45</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 9.25 19/1/2027	3.000,0000	108,30100000	324.903,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS PCL			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27	Επιτόκιο: 9.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>324.903,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>324.903,00</b>
<b>3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ</b>			
AEONIC SECURITIES CIF PLC	13.000,0000	0,75000000	9.750,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.3</b>			<b>9.750,00</b>
<b>4. ΛΟΙΠΟΙ ΟΡΓΑΝΙΣΜΟΙ ΣΥΛΛΟΓΙΚΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ</b>			
GMM MARATHON ASSETS CYPRUS BOND FUND	74.923,2040	9,79570000	733.925,23
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.4</b>			<b>733.925,23</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>1.659.608,68</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
EUROPEAN INV 21-12/2017	6.600,0000	26,79760638	176.864,20
- Isin: XS1014703851			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 07-JAN-14 - 21-DEC-17	Επιτόκιο: 10.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	410.000,0000	1,50366645	616.503,24
- Isin: XS1333828280			
- Εκδότης: INTL FINANCE CORP			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 17-DEC-15 - 17-DEC-18	Επιτόκιο: 8.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PPC FINANCE 1/5/2019	2.000,0000	87,39400000	174.788,00
- Isin: XS1063837741			
- Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19	Επιτόκιο: 5.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OPAP 21/3/2022	3.000,0000	101,25100000	303.753,00
- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22	Επιτόκιο: 3.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
MOTOROIL 3.25 01/4/2022	4.000,0000	101,87400000	407.496,00

- Isin: XS1586710185			
- Εκδότης: MOTOR OIL FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-MAR-17 - 01-APR-22	Επιτόκιο: 3.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>BRF 3/6/2022</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>100,77300000</b>	<b>302.319,00</b>
- 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:			
<b>SYSTEMS SUNLIGHT ABEE 20/6/2022</b>	<b>1.170,0000</b>	<b>100,65000000</b>	<b>117.760,50</b>
- Isin: GRC8121176B9			
- Εκδότης: SYSTEMS SUNLIGHT ABEE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-17 - 20-JUN-22	Επιτόκιο: 4.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1%</b>	<b>2.470,0000</b>	<b>100,31000000</b>	<b>247.765,70</b>
- Isin: GRC3931176B0			
- Εκδότης: ΜΥΤΙΛΙΝΕΟΣ HOLDINGS S.A.			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-17 - 26-JUN-22	Επιτόκιο: 3.1%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			

- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>GAZPROM 3.125% 17/11/2023</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>104,50500000</b>	<b>313.515,00</b>
- Isin: XS1521039054			
- Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-NOV-16 - 17-NOV-23	Επιτόκιο: 3.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>NOKIA 15/3/2024</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>101,73500000</b>	<b>305.205,00</b>
- Isin: XS1577731604			
- Εκδότης: NOKIA OYJ			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-MAR-17 - 15-MAR-24	Επιτόκιο: 2%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>REPUBLIC OF PORTUGAL 15/10/2024</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>89,44619699</b>	<b>268.338,59</b>
- Isin: XS1085735899			
- Εκδότης: REPUBLIC OF PORTUGAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-JUL-14 - 15-OCT-24	Επιτόκιο: 5.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>PETROBRAS 4.75% 14/01/2025</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>102,28200000</b>	<b>306.846,00</b>
- 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: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>LEVI STRAUSS 15/3/2027</b>	<b>2.000,0000</b>	<b>101,09700000</b>	<b>202.194,00</b>
- Isin: XS1602130947			
- Εκδότης: LEVI STRAUSS & CO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-FEB-17 - 15-MAR-27	Επιτόκιο: 3.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>OBRIGACOES DO TESOURO 14/04/2027</b>	<b>2.000,0000</b>	<b>109,19800000</b>	<b>218.396,00</b>
- Isin: PTOTEUOE0019			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-17 - 14-APR-27	Επιτόκιο: 4.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>PETROLEOS MEXICANOS 21/2/2028</b>	<b>4.000,0000</b>	<b>104,16300000</b>	<b>416.652,00</b>
- Isin: XS1568888777			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-FEB-17 - 21-FEB-28	Επιτόκιο: 4.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>TESCO PLC, 10/4/2047 5.125%</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>105,41800000</b>	<b>316.254,00</b>
- Isin: XS0295018070			
- Εκδότης: TESCO PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-APR-07 - 10-APR-47	Επιτόκιο: 5.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>4.694.650,23</b>
<b>ZERO COUPON</b>			
<b>GTB 0 15/9/17</b>	<b>3.000,0000</b>	<b>99,53400000</b>	<b>298.602,00</b>
- Isin: GRO000168717			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-JUN-17 - 15-SEP-17	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C			

- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON</b>			<b>298.602,00</b>
<b>STEPPED</b>			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	3.000,0000	93,44900000	280.347,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27	Επιτόκιο: 5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
<b>ΣΥΝΟΛΟ STEPPED</b>			<b>280.347,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.1</b>			<b>5.273.599,23</b>
<b>2. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ</b>			
PUBLIC POWER CORP.	30.000,0000	2,19000000	65.700,00
A.D.M.H.E. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε	30.000,0000	2,24000000	67.200,00
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	2.000.000,0000	0,21500000	430.000,00
NATIONAL BANK OF GREECE	1.000.000,0000	0,33300000	333.000,00
EUROBANK	250.000,0000	0,98000000	245.000,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>1.140.900,00</b>
<b>3. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ</b>			
ISHARES EM LOCAL GOV BND	10.500,0000	57,86000000	607.530,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>607.530,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)</b>			<b>7.022.029,23</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)</b>			<b>8.681.637,91</b>
<b>ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>368.998,56</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>9.050.636,47</b>
<b>ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)</b>			<b>0,00</b>

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