

GMM THEMELIO BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ		ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ				
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO				352.718,74
CASH ACCOUNT IN USD	20.740,5200		0,87627059	18.174,31
ΣΥΝΟΛΟ I.1				370.893,05
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ				
FIXED				
CYPRUS 3.75 26/7/2023	1.050,0000		109,40950000	114.879,98
- Isin: XS1457553367				
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUL-16 - 26-JUL-23				Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed				Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-				
- Πρόσθετοι Όροι:				
CYPRUS 9.25 19/1/2027	1.000,0000		108,30100000	108.301,00
- Isin: XS1551761569				
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS PCL				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27				Επιτόκιο: 9.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed				Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2				
- Πρόσθετοι Όροι:				
ΣΥΝΟΛΟ FIXED				223.180,98
ΣΥΝΟΛΟ I.2				223.180,98
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)				594.074,03
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ				
FIXED				
FRIGOGLOSS 8,25% 15/05/2018	1.000,0000		55,62500000	55.625,00
- Isin: XS0932291007				
- Εκδότης: FRIGOGLOSS FINANCE BV				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-13 - 15-MAY-18				Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed				Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: D				
- Πρόσθετοι Όροι:				
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000		106,00600000	106.006,00
- 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	2.000,0000		105,21600000	210.432,00
- 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:				
VALE BZ 4.375% 11/1/2022	1.000,0000		89,27882930	89.278,83
- Isin: US91911TAM53				
- Εκδότης: VALE OVERSEAS LIMITED				
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JAN-12 - 11-JAN-22				Επιτόκιο: 4.375%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed				Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2				
- Πρόσθετοι Όροι:				
SYSTEMS SUNLIGHT ABEE 20/6/2022	580,0000		100,65000000	58.377,00

- 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:			
ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1%	920,0000	100,31000000	92.285,20
- Isin: GRC3931176B0			
- Εκδότης: MYTILINEOS 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:			
NOVATEK 13/12/2022	2.000,0000	89,36295128	178.725,90
- Isin: XS0864383723			
- Εκδότης: NOVATEK(NOVATEK FIN LTD)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-12 - 13-DEC-22	Επιτόκιο: 4.422%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS 4.75% 14/01/2025	1.000,0000	102,28200000	102.282,00
- 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:			
OBRIGACOES DO TESOURO 14/04/2027	1.000,0000	109,19800000	109.198,00
- 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:			
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028	1.000,0000	109,66600000	109.666,00
- Isin: XS1432493440			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JUN-16 - 14-JUN-28	Επιτόκιο: 3.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			1.111.875,93
FLOATING			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.000,0000	94,53645286	94.536,45
- Isin: US71656MBN83			

- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.8781%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			94.536,45
ZERO COUPON			
GTB 0 08/09/17	500,0000	99,57900000	49.789,50
- Isin: GR0000167701			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUN-17 - 08-SEP-17	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			49.789,50
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	93,44900000	93.449,00
- 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			
GGB 3% 24/02/2038	1.500,0000	72,65400000	108.981,00
- Isin: GR0138010765			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-38	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			202.430,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			1.458.631,88
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	2.651,8897	46,62000000	123.631,10
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CELTONA LTD 15/12/2019	262,0000	100,00000000	26.200,00
- Isin:			
- Εκδότης: CELTONA LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-16 - 15-DEC-19	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή:		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			149.831,10
ΣΥΝΟΛΟ II.2			149.831,10
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
QUALITY & RELIABILITY SA	53.952,0000	0,19000000	10.250,88
EUROBANK	57.300,0000	0,98000000	56.154,00
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	220.000,0000	0,21500000	47.300,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			113.704,88
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			26.865,81

MARGIN IN USD/BETA	41.479,0800	0,87627059	36.346,90
ΣΥΝΟΛΟ II.4			63.212,71
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	2.200,0000	24,73273747	54.412,02
ΣΥΝΟΛΟ II.5			54.412,02
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.839.792,59
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			2.433.866,62
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			20.766,81
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			2.454.633,43
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON CURRENCY			
EURO FX USD CURR FUT SEP17	3,0000	1,14670000	376.807,31
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			376.807,31
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			376.807,31
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			376.807,31

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