

## GMM THEMELIO BALANCED FUND

### ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN USD	9.042,7900	0,89373492	8.081,86
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			854.527,10
CASH ACCOUNT IN GBP	36.503,1100	1,40567894	51.311,65
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>913.920,61</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 4.75 25/6/2019	2.500,0000	103,36000000	258.400,00
- Isin: XS1081101807			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUN-14 - 25-JUN-19 Επιτόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4.625 3/2/2020	500,0000	102,82400000	51.412,00
- Isin: XS0483954144			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-10 - 03-FEB-20 Επιτόκιο: 4.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	1.000,0000	100,19800000	100.198,00
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>410.010,00</b>
<b>ZERO COUPON</b>			
CYPRUS TBILL 17/7/2015	1.500,0000	99,80100000	149.701,50
- Isin: CY0145780819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JUN-15 - 17-JUL-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 07/8/2015	1.500,0000	99,55900000	149.338,50
- Isin: CY0145700817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-15 - 07-AUG-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 4/9/2015	1.000,0000	99,23800000	99.238,00
- Isin: CY0145760811			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-JUN-15 - 04-SEP-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON</b>			<b>398.278,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>808.288,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>1.722.208,61</b>

## II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

### 1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ

MARGIN IN USD/BETA	25.772,5700	0,89373492	23.033,85
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.1</b>			<b>23.033,85</b>

### 2. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ

#### FIXED

GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	140,56789429	295.895,42
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: GB00BBHXPS12</li> <li>- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
KOF 2.375% 26/11/2018	1.500,0000	90,80614890	136.209,22
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: US191241AG32</li> <li>- Εκδότης: COCA-COLA FEMSA SAB CV</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-NOV-13 - 26-NOV-18 Επιτόκιο: 2.375%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
PFOURS 5.25 1/2/2019	3.000,0000	102,62500000	307.875,00
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS0982710153</li> <li>- Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-FEB-19 Επιτόκιο: 5.25%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
IEP 4.875 15/3/2019	1.000,0000	90,26722674	90.267,23
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: US451102BB24</li> <li>- Εκδότης: ICAHN ENTERPRISES/FIN</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-MAY-14 - 15-MAR-19 Επιτόκιο: 4.875%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL 02/12/2019	1.000,0000	100,08000000	100.080,00
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1147600305</li> <li>- Εκδότης: GLAXOSMITHKLINE CAPITAL</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-14 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: .625%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
PIAGIM 4.625 30/4/2021	1.000,0000	102,75000000	102.750,00
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1061086846</li> <li>- Εκδότης: PIAGGIO &amp; C SPA</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-14 - 30-APR-21 Επιτόκιο: 4.625%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
GM 4.375 25/9/2021	1.500,0000	92,72499777	139.087,50
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: US37045XAQ97</li> <li>- Εκδότης: GENERAL MOTORS FINL CO</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-SEP-14 - 25-SEP-21 Επιτόκιο: 4.375%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
VESTAS WIND 11/3/2022	1.000,0000	96,06000000	96.060,00
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1197336263</li> <li>- Εκδότης: VESTAS WIND SYSTEMS A/S</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-MAR-15 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 2.75%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			

<b>EMPRESA 5.15 15/06/2022</b>	1.200,0000	92,44793994	110.937,53
- Isin: US29082AAA51			
- Εκδότης: EMPRESA BRAS DE AERONAU			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUN-12 - 15-JUN-22 Επιτόκιο: 5.15%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>FIAT 4.75 15/07/22</b>	1.000,0000	104,87500000	104.875,00
- Isin: XS1088515207			
- Εκδότης: FIAT CHRYSLER FINANCE EU			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-22 Επιτόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>SLB 2.4% 1/8/2022</b>	1.500,0000	85,35704710	128.035,57
- Isin: USL81445AD75			
- Εκδότης: SCHLUMBERGER INVESTMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JUL-12 - 01-AUG-22 Επιτόκιο: 2.4%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>MEX 2.75% 22/4/2023</b>	1.000,0000	103,62100000	103.621,00
- Isin: XS0916766057			
- Εκδότης: UNITED MEXICAN STATES			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-13 - 22-APR-23 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>VMED 15/1/2025</b>	1.000,0000	99,37500000	99.375,00
- Isin: XS1169920193			
- Εκδότης: VIRGIN MEDIA FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 15-JAN-25 Επιτόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>GLENCORE 1.75 17/3/2025</b>	1.250,0000	91,09200000	113.865,00
- Isin: XS1202849086			
- Εκδότης: GLENCORE FINANCE EUROPE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-15 - 17-MAR-25 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>OBRIGACOES DO TESOURO 15/04/2037</b>	600,0000	105,37000000	63.222,00
- Isin: PTOT50E0007			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-06 - 15-APR-37 Επιτόκιο: 4.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>1.992.155,47</b>
<b>ZERO COUPON</b>			
<b>BILHETES DO TESOURO 18/12/2015</b>	2.000,0000	99,95900000	199.918,00
- Isin: PTPBTIGE0025			
- Εκδότης: BILHETES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-14 - 18-DEC-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON</b>			<b>199.918,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>2.192.073,47</b>

**3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ**

ΚΛΕΡΙΕΡΡΕ	430,0000	39,45500000	16.965,65
SOCIETE GENERALE SA	440,0000	41,87000000	18.422,80
VESTAS WIND SYSTEMS	475,0000	44,36000000	21.071,00
CONTINENTAL AG	90,0000	212,25000000	19.102,50
ENEL sPA	4.650,0000	4,06400000	18.897,60
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>94.459,55</b>

**4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ**

LYXOR JPY-NK400 DLYHDG-C EUR	250,0000	118,62000000	29.655,00
------------------------------	----------	--------------	-----------

**ΣΥΝΟΛΟ II.4**

**29.655,00**

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)**

**2.339.221,87**

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)**

**4.061.430,48**

**ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ**

**-161.701,90**

**ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ**

**3.899.728,58**

**III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ**

**1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY**

EUR FX USD FUT SEP15	4,0000	1,11560000	498.525,34
----------------------	--------	------------	------------

**ΣΥΝΟΛΟ III.1**

**498.525,34**

**ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)**

**498.525,34**

**ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)**

**498.525,34**

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