

GMM THEMELIO BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Β

| ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ | ΤΕΜΑΧΙΑ | ΤΙΜΗ | ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ |
|--|-------------|----------------------------|----------------------------|
| | | ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ | ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ |
| I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ | | | |
| CASH ACCOUNT IN USD | 10.187,3400 | 0,90073861 | 9.176,13 |
| EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO | | | 483.944,37 |
| CASH ACCOUNT IN GBP | 9.529,8000 | 1,20992136 | 11.530,31 |
| ΣΥΝΟΛΟ I.1 | | | 504.650,81 |
| 2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ | | | |
| FIXED | | | |
| CYPRUS 2 18/1/2018 | 470,0000 | 99,71050000 | 46.863,94 |
| - Isin: CY0146220815 | | | |
| - Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18 Επιδόκιο: 2% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| CYPRUS 4.625 3/2/2020 | 500,0000 | 106,55650000 | 53.278,25 |
| - Isin: XS0483954144 | | | |
| - Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-10 - 03-FEB-20 Επιδόκιο: 4.625% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| CYPRUS 06/5/2022 | 1.000,0000 | 102,61250000 | 102.612,50 |
| - Isin: XS1227247191 | | | |
| - Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-15 - 06-MAY-22 Επιδόκιο: 3.875% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B- | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| REP OF CYPRUS 4/11/2025 | 2.700,0000 | 103,49450000 | 279.435,15 |
| - Isin: XS1314321941 | | | |
| - Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-15 - 04-NOV-25 Επιδόκιο: 4.25% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+ | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ FIXED | | | 482.189,84 |
| ΣΥΝΟΛΟ I.2 | | | 482.189,84 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I) | | | |
| | | | 986.840,65 |
| II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΕΔ | | | |
| FIXED | | | |
| HELL REPUBLIC 17/7/2017 | 1.000,0000 | 95,92100000 | 95.921,00 |
| - Isin: GR0110029312 | | | |
| - Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-JUL-14 - 17-JUL-17 Επιδόκιο: 3.375% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| VODAFONE GROUP 26/9/2017 | 1.000,0000 | 90,05854801 | 90.058,55 |
| - Isin: US92857WAY66 | | | |
| - Εκδότης: VODAFONE GROUP PLC | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-SEP-12 - 26-SEP-17 Επιδόκιο: 1.25% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |

| | | | |
|--|------------|--------------|------------|
| BAO TRANS ENTERPRICE | 1.000,0000 | 100,02600000 | 100.026,00 |
| - Isin: XS1181873776 | | | |
| - Εκδότης: BAO-TRANS ENTERPRISE | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-FEB-15 - 23-FEB-18 Επιτόκιο: 1.625% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| FRIGOGLASS 8,25% 15/05/2018 | 1.000,0000 | 60,25000000 | 60.250,00 |
| - Isin: XS0932291007 | | | |
| - Εκδότης: FRIGOGLASS FINANCE BV | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-13 - 15-MAY-18 Επιτόκιο: 8.25% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC+ | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| BGB 1.25 22/6/2018 | 6.750,0000 | 103,62900000 | 699.495,75 |
| - Isin: BE0000329384 | | | |
| - Εκδότης: BELGIUM KINGDOM | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-FEB-13 - 22-JUN-18 Επιτόκιο: 1.25% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: AA | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| TORON. DOM BANK 10/09/2018 | 920,0000 | 92,68870474 | 85.273,61 |
| - Isin: US89114QAM06 | | | |
| - Εκδότης: TORONTO-DOMINION BANK | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-SEP-13 - 10-SEP-18 Επιτόκιο: 2.625% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| PFOURS 5.25 1/2/2019 | 3.000,0000 | 102,12500000 | 306.375,00 |
| - Isin: XS0982710153 | | | |
| - Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-FEB-19 Επιτόκιο: 5.25% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19 | 1.500,0000 | 97,83600000 | 146.754,00 |
| - Isin: XS1083287547 | | | |
| - Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JUL-14 - 04-JUL-19 Επιτόκιο: 5.25% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| OTE PLC 4.375% 02/12/2019 | 2.000,0000 | 100,69200000 | 201.384,00 |
| - Isin: XS1327539976 | | | |
| - Εκδότης: OTE PLC | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-15 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: 4.375% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ALTRIA 2.625 14/1/2020 | 1.500,0000 | 93,64438840 | 140.466,58 |
| - Isin: US02209SAT06 | | | |
| - Εκδότης: ALTRIA GROUP INC | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-NOV-14 - 14-JAN-20 Επιτόκιο: 2.625% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ANADARKO PETR. 15/3/2021 | 2.000,0000 | 95,47739146 | 190.954,78 |
| - Isin: US032511BM81 | | | |
| - Εκδότης: ANADARKO PETROLEUM CORP | | | |
| - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-16 - 15-MAR-21 Επιτόκιο: 4.85% | | | |
| - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG | | | |
| - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 | | | |
| - Πρόσθετοι Όροι: | | | |

| | | | |
|---|------------|--------------|---------------------|
| PIAGIM 4.625 30/4/2021 | 1.000,0000 | 102,87500000 | 102.875,00 |
| <ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1061086846 - Εκδότης: PIAGGIO & C SPA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-14 - 30-APR-21 Επιτόκιο: 4.625% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1 - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| EMPRESA 5.15 15/06/2022 | 1.200,0000 | 92,28607458 | 110.743,29 |
| <ul style="list-style-type: none"> - 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: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| MEX 2.75% 22/4/2023 | 1.000,0000 | 107,99600000 | 107.996,00 |
| <ul style="list-style-type: none"> - 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: | | | |
| VMED 15/1/2025 | 1.000,0000 | 96,50000000 | 96.500,00 |
| <ul style="list-style-type: none"> - 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: | | | |
| GLENCORE 1.75 17/3/2025 | 1.250,0000 | 82,90900000 | 103.636,25 |
| <ul style="list-style-type: none"> - 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: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| OBRIGACOES DO TESOURO 15/04/2037 | 600,0000 | 103,72600000 | 62.235,60 |
| <ul style="list-style-type: none"> - Isin: PTOTE5OE0007 - 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: | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ FIXED | | | 2.700.945,41 |
| STEPPED | | | |
| GGB 3% 24/02/2038 | 1.500,0000 | 59,19100000 | 88.786,50 |
| <ul style="list-style-type: none"> - 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 | | | 88.786,50 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.1 | | | 2.789.731,91 |
| 2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ | | | |
| FIXED | | | |
| GLOBO TECH 9% 20/6/2018 | 2.105,0000 | 90,74410163 | 191.016,33 |
| <ul style="list-style-type: none"> - Isin: GB00BBHXPS12 - Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A - Πρόσθετοι Όροι: | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ FIXED | | | 191.016,33 |

| | | | |
|---|-------------|--------------|---------------------|
| ΣΥΝΟΛΟ II.2 | | | 191.016,33 |
| 3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ | | | |
| CONTINENTAL AG | 90,0000 | 169,30000000 | 15.237,00 |
| EUROBANK | 57.300,0000 | 0,55000000 | 31.515,00 |
| KLEPIERRE | 430,0000 | 39,85000000 | 17.135,50 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.3 | | | 63.887,50 |
| 4. MARGIN | | | |
| MARGIN IN USD/ΒΕΤΑ | 24.709,5500 | 0,90073861 | 22.256,85 |
| MARGIN IN GBP/ΒΕΤΑ | 13.625,0000 | 1,20992136 | 16.485,18 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.4 | | | 38.742,03 |
| 5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ | | | |
| ISHARES SILVER TRUST | 7.100,0000 | 16,09169519 | 114.251,04 |
| DBX II ITRX CROSSOVER SHORT | 1.920,0000 | 51,30000000 | 98.496,00 |
| ΣΥΝΟΛΟ II.5 | | | 212.747,04 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II) | | | 3.296.124,81 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) | | | 4.282.965,46 |
| ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ | | | 64.419,54 |
| ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ | | | 4.347.385,00 |
| | | | |
| IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY | | | |
| EURO FX GBP CURR sep16 | 2,0000 | 0,83845000 | 253.614,64 |
| - Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES | | | |
| ΣΥΝΟΛΟ IV.1 | | | 253.614,64 |
| ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV) | | | 253.614,64 |
| ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV) | | | 253.614,64 |

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