

**GMM THEMELIO BALANCED FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016**

Τρίμηνο: Γ

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 GBP	11.774,6300	1,16139972	13.675,05
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			609.578,49
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			349.970,00
CASH ACCOUNT IN USD	15.315,5000	0,89597706	13.722,34
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>986.945,88</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 2 18/1/2018	470,0000	100,80850000	47.380,00
- Isin: CY0146220815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18	Επιτόκιο: 2%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.75 26/7/2023	1.050,0000	103,16950000	108.327,98
- 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: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.700,0000	106,45650000	287.432,55
- Isin: XS1314321941			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-15 - 04-NOV-25	Επιτόκιο: 4.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>443.140,53</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>443.140,53</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>1.430.086,41</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
HELL REPUBLIC 17/7/2017	1.000,0000	98,07800000	98.078,00
- Isin: GR0110029312			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-JUL-14 - 17-JUL-17	Επιτόκιο: 3.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BAO TRANS ENTERPRICE	1.000,0000	101,04500000	101.045,00
- 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:			
FRIGOGLOSS 8,25% 15/05/2018	1.000,0000	62,62500000	62.625,00
- Isin: XS0932291007			
- Εκδότης: FRIGOGLOSS 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:			

<b>TORON. DOM BANK 10/09/2018</b>	920,0000	91,61544664	84.286,21
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: US89114QAM06</li> <li>- Εκδότης: TORONTO-DOMINION BANK</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-SEP-13 - 10-SEP-18 Επιτόκιο: 2.625%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>PFOURS 5.25 1/2/2019</b>	3.000,0000	102,37500000	307.125,00
<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>			
<b>HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19</b>	1.500,0000	101,04500000	151.567,50
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1083287547</li> <li>- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JUL-14 - 04-JUL-19 Επιτόκιο: 5.25%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>PIRELLI INT 18/11/2019</b>	1.000,0000	100,82800000	100.828,00
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1139287350</li> <li>- Εκδότης: PIRELLI INTERNATIONAL</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-NOV-14 - 18-NOV-19 Επιτόκιο: 1.75%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>OTE PLC 4.375% 02/12/2019</b>	2.000,0000	103,32000000	206.640,00
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: XS1327539976</li> <li>- Εκδότης: OTE PLC</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-15 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: 4.375%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>ALTRIA 2.625 14/1/2020</b>	1.500,0000	92,71033062	139.065,50
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: US02209SAT06</li> <li>- Εκδότης: ALTRIA GROUP INC</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-NOV-14 - 14-JAN-20 Επιτόκιο: 2.625%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>ANADARKO PETR. 15/3/2021</b>	2.000,0000	96,44117911	192.882,36
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: US032511BM81</li> <li>- Εκδότης: ANADARKO PETROLEUM CORP</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-16 - 15-MAR-21 Επιτόκιο: 4.85%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>PIAGIM 4.625 30/4/2021</b>	1.000,0000	103,50000000	103.500,00
<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: B1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			
<b>GM 3.20 06/7/2021</b>	1.000,0000	90,82967476	90.829,67
<ul style="list-style-type: none"> <li>- Isin: US37045XBM74</li> <li>- Εκδότης: GENERAL MOTORS FINL CO</li> <li>- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-JUL-16 - 06-JUL-21 Επιτόκιο: 3.2%</li> <li>- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG</li> <li>- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1</li> <li>- Πρόσθετοι Όροι:</li> </ul>			

REPUBLIC OF INDONESIA 8/7/2021	1.000,0000	106,86800000	106.868,00
- Isin: XS1084368593			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUL-14 - 08-JUL-21 Επιτόκιο: 2.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000	100,12900000	100.129,00
- 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:			
EMPRESA 5.15 15/06/2022	1.200,0000	95,04435086	114.053,22
- 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:			
ABXCN 4.1% 1/5/2023	1.200,0000	96,65800556	115.989,61
- Isin: US067901AQ17			
- Εκδότης: BARRICK GOLD CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-SEP-13 - 01-MAY-23 Επιτόκιο: 4.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VMED 15/1/2025	1.000,0000	99,00000000	99.000,00
- 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>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>2.174.512,07</b>
<b>STEPPED</b>			
GGB 3% 24/02/2038	1.500,0000	58,31300000	87.469,50
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ STEPPED</b>			<b>87.469,50</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.1</b>			<b>2.261.981,57</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	58,06998595	122.237,32
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>122.237,32</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>122.237,32</b>
<b>3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ</b>			
EUROBANK	57.300,0000	0,50800000	29.108,40
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>29.108,40</b>
<b>4. MARGIN</b>			
MARGIN IN GBP/BETA	29.820,0000	1,16139972	34.632,94
MARGIN IN USD/BETA	24.690,6300	0,89597706	22.122,24
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.4</b>			<b>56.755,18</b>

**5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ**

ETFS PRECIOUS METALS	6.050,0000	16,23500000	98.221,75
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	3.700,0000	49,22000000	182.114,00
ISHARES EM ASIA MLCL GOV BND	1.150,0000	85,84000000	98.716,00
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.5</b>			<b>379.051,75</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)</b>			<b>2.849.134,22</b>

**ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)**

<b>ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>4.279.220,63</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>4.330.233,88</b>

**IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ**

**1. FUTURES ON CURRENCY**

EURO FX GBP CURR FUT DEC16	1,0000	0,86765000	125.961,06
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			

**ΣΥΝΟΛΟ IV.1**

<b>ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)</b>			<b>125.961,06</b>
<b>ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)</b>			<b>125.961,06</b>

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