

GMM THEMELIO BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	11.209,1500	0,94867660	10.633,86
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			39.365,58
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			239.940,00
CASH ACCOUNT IN GBP	11.774,6300	1,16797870	13.752,52
ΣΥΝΟΛΟ I.1			303.691,96
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	470,0000	101,28850000	47.605,60
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.75 26/7/2023	1.050,0000	102,44800000	107.570,40
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			155.176,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			155.176,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			458.867,96
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΑ			
FIXED			
BAO TRANS ENTERPRICE	1.000,0000	100,97800000	100.978,00
- 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	63,75000000	63.750,00
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	1.000,0000	101,75000000	101.750,00
- 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:			

OTE PLC 4.375% 02/12/2019	2.000,0000	104,29100000	208.582,00
- 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:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000	101,45000000	101.450,00
- 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	99,56500000	199.130,00
- 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	93,44464472	93.444,64
- 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: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NOVATEK 13/12/2022	2.000,0000	93,91898302	187.837,97
- Isin: XS0864383723			
- Εκδότης: 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:			
VMED 15/1/2025	1.000,0000	103,25000000	103.250,00
- 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:			
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028	1.000,0000	102,01500000	102.015,00
- 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			1.262.187,61
FLOATING			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.000,0000	97,57707997	97.577,08
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 4.6065%			
- Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			97.577,08

STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	88,27600000	88.276,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27 Επιδόκιο: 5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3e			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
GGB 3% 24/02/2038	1.500,0000	62,35700000	93.535,50
- Isin: GR0138010765			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-38 Επιδόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			181.811,50
ΣΥΝΟΛΟ II.1			1.541.576,19
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	2.501,7827	49,42000000	123.638,10
- Isin: GB00BBHXP512			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιδόκιο: 6%			
- 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 Επιδόκιο: 3%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			149.838,10
ΣΥΝΟΛΟ II.2			149.838,10
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
EUROBANK	57.300,0000	0,64500000	36.958,50
QUALITY & RELIABILITY SA	53.952,0000	0,33100000	17.858,11
ΣΥΝΟΛΟ II.3			54.816,61
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			26.888,13
MARGIN IN USD/BETA	27.886,8300	0,94867660	26.455,58
ΣΥΝΟΛΟ II.4			53.343,71
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	2.200,0000	27,57793378	60.671,45
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	3.400,0000	16,81000000	57.154,00
ΣΥΝΟΛΟ II.5			117.825,45
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.917.400,06
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			2.376.268,02
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			22.024,17
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			2.398.292,19
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			0,00

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