

GMM THEMELIO BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN GBP	9.529,8000	1,26334407	12.039,42
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			558.147,04
CASH ACCOUNT IN USD	123.389,1900	0,87834870	108.378,74
ΣΥΝΟΛΟ I.1			678.565,20
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	470,0000	98,45500000	46.273,85
- 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 4.625 3/2/2020	500,0000	105,70400000	52.852,00
- 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	102,42250000	102.422,50
- 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:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	2.700,0000	103,21850000	278.689,95
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			480.238,30
ΣΥΝΟΛΟ I.2			480.238,30
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			
			1.158.803,50
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
VODAFONE GROUP 26/9/2017	1.000,0000	87,61703996	87.617,04
- Isin: US92857WAY66			
- Εκδότης: VODAFONE GROUP PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-SEP-12 - 26-SEP-17 Επιτόκιο: 1.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BAO TRANS ENTERPRICE	1.000,0000	99,37900000	99.379,00
- 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: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			

FRIGOGLASS 8,25% 15/05/2018	1.000,0000	62,39400000	62.394,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	103,80400000	700.677,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	89,99472991	82.795,15
<ul style="list-style-type: none"> - 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	102,50000000	307.500,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	87,89500000	131.842,50
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019	1.000,0000	100,25000000	100.250,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1082459568 - Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 15-NOV-19 Επιτόκιο: 3.3524% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	2.000,0000	99,38700000	198.774,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	90,66403162	135.996,05
<ul style="list-style-type: none"> - 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: Baa1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GAZPROM 3.389% 20/03/2020	1.500,0000	99,87500000	149.812,50
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0906946008 - Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA) - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-13 - 20-MAR-20 Επιτόκιο: 3.389% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			

PIAGIM 4.625 30/4/2021	1.000,0000	103,62500000	103.625,00
- 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:			
VESTAS WIND 11/3/2022	1.000,0000	101,09800000	101.098,00
- Isin: XS1197336263			
- Εκδότης: VESTAS WIND SYSTEMS A/S			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-MAR-15 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BRF 3/6/2022	1.000,0000	92,59700000	92.597,00
- Isin: XS1242327168			
- Εκδότης: BRF SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-15 - 03-JUN-22 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EMPRESA 5.15 15/06/2022	1.200,0000	83,89108476	100.669,30
- 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:			
MEX 2.75% 22/4/2023	1.000,0000	105,36300000	105.363,00
- 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:			
VMED 15/1/2025	1.000,0000	96,75000000	96.750,00
- 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:			
GLENCORE 1.75 17/3/2025	1.250,0000	75,34900000	94.186,25
- 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 TESOIRO 15/04/2037	600,0000	106,11900000	63.671,40
- Isin: PTOTE5OE0007			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOIRO			
- 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			2.814.997,19
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.814.997,19
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	2.105,0000	75,80064431	159.560,36
- 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			159.560,36

ΣΥΝΟΛΟ II.2			159.560,36
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
CONTINENTAL AG	90,0000	200,00000000	18.000,00
EUROBANK	57.300,0000	0,77900000	44.636,70
KLEPIERRE	430,0000	42,10000000	18.103,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			80.739,70
4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	49.719,3700	0,87834870	43.670,94
ΣΥΝΟΛΟ II.4			43.670,94
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			3.098.968,19
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			4.257.771,69
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-22.810,74
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			4.234.960,95
III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EURO FX USD CURR FUT jun16	5,0000	1,14120000	626.482,21
ΣΥΝΟΛΟ III.1			626.482,21
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			626.482,21
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			626.482,21

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