

GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

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 NOK	3,9700	0,10447902	0,41
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			196.451,83
CASH ACCOUNT IN USD	1.672,0300	0,87627059	1.465,15
ΣΥΝΟΛΟ I.1			197.917,39
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	109,39450000	109.394,50
- Isin: CY0146250812			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-23 Επιτόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 9.25 19/1/2027	1.000,0000	108,30100000	108.301,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS PCL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27 Επιτόκιο: 9.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			217.695,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			217.695,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			415.612,89
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	2.100,0000	27,22154255	57.165,24
- Isin: XS1136802615			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-NOV-14 - 19-JUN-18 Επιτόκιο: 10%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	42.000,0000	1,50366645	63.153,99
- Isin: XS1333828280			
- Εκδότης: INTL FINANCE CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-DEC-15 - 17-DEC-18 Επιτόκιο: 8.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.000,0000	105,70100000	105.701,00
- 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: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	500,0000	100,00000000	50.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-20 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			

HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	1.000,0000	105,21600000	105.216,00
- 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	880,0000	89,27882930	78.565,37
- 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: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OPAP 21/3/2022	600,0000	101,25100000	60.750,60
- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22 Επιτόκιο: 3.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1%	530,0000	100,31000000	53.164,30
- Isin: GRC3931176B0			
- Εκδότης: MYTILINEOS HOLDINGS S.A.			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-17 - 26-JUN-22 Επιτόκιο: 3.1%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS ARGENTINA 21/7/2023	520,0000	92,44567122	48.071,75
- Isin: USP7873PAE62			
- Εκδότης: PETROBRAS ARGENTINA SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUL-16 - 21-JUL-23 Επιτόκιο: 7.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ASSICURAZIONI GENERALI 4/5/2026	1.000,0000	108,23200000	108.232,00
- Isin: XS1062900912			
- Εκδότης: ASSICURAZIONI GENERALI			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-MAY-14 - 04-MAY-26 Επιτόκιο: 4.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			730.020,25
FLOATING			
GOLDMAN SACHS 15/11/2021	750,0000	88,42271293	66.317,03
- Isin: US38145GAF72			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21 Επιτόκιο: 2.3518%			
- Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.000,0000	94,53645286	94.536,45
- Isin: US71656MBN83			

- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.8781%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			160.853,48
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	93,44900000	93.449,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27	Επιτόκιο: 5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			93.449,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			984.322,73
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	662,9724	46,62000000	30.907,77
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CELTONA LTD 15/12/2019	66,0000	100,00000000	6.600,00
- Isin:			
- Εκδότης: CELTONA LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-16 - 15-DEC-19	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή:		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			37.507,77
ΣΥΝΟΛΟ II.2			37.507,77
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
QUALITY & RELIABILITY SA	13.488,0000	0,19000000	2.562,72
ING GROUP NV	1.100,0000	15,10000000	16.610,00
LUKOIL PJSC-SPON ADR	400,0000	42,67437785	17.069,75
ABB LTD-REG	1.830,0000	21,66514181	39.647,21
POSCO -SPON ADR	690,0000	54,84577638	37.843,59
LANXESS AG	590,0000	66,29000000	39.111,10
DEUTSCHE BANK AG	1.150,0000	15,52500000	17.853,75
ΣΥΝΟΛΟ II.3			170.698,12
4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	36.306,2400	0,87627059	31.814,09
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			96,52
ΣΥΝΟΛΟ II.4			31.910,61
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
POWERSHARES DB COMM.IND	7.070,0000	12,66211006	89.521,12
ΣΥΝΟΛΟ II.5			89.521,12
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.313.960,35
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.729.573,24
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			17.949,23
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.747.522,47

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES ON CURRENCY

EURO FX USD CURR FUT SEP17	3,0000	1,14670000	376.807,31
----------------------------	--------	------------	------------

- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

376.807,31

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

376.807,31

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

376.807,31

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