

GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	1.296,6100	0,89373492	1.158,83
CASH ACCOUNT IN GBP	4.737,2100	1,40567894	6.659,00
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			131.270,54
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			69.970,00
ΣΥΝΟΛΟ I.1			209.058,37
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.75 25/6/2019	1.200,0000	103,36000000	124.032,00
- Isin: XS1081101807			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUN-14 - 25-JUN-19			Επιτόκιο: 4.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	1.000,0000	100,19800000	100.198,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			224.230,00
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 17/7/2015	500,0000	99,80100000	49.900,50
- Isin: CY0145780819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JUN-15 - 17-JUL-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 07/8/2015	500,0000	99,55900000	49.779,50
- Isin: CY0145700817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-15 - 07-AUG-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			99.680,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			323.910,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			532.968,37
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
MARGIN IN USD/BETA	21.886,2200	0,89373492	19.560,48
ΣΥΝΟΛΟ II.1			19.560,48
2. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	700,0000	100,00000000	70.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17			Επιτόκιο: 7.45%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			

GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	140,56789429	73.973,85
<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: - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A - Πρόσθετοι Όροι: 			
PETROBRAS 5.375% 27/01/2021	550,0000	85,91026901	47.250,65
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US71645WAR25 - Εκδότης: PETROBRAS GLOBAL FINANCE - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-JAN-11 - 27-JAN-21 Επιτόκιο: 5.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
VALE BZ 4.375% 11/1/2022	650,0000	87,34024488	56.771,16
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
PETROLEOS MEXICANOS 30/1/2023	600,0000	84,65814639	50.794,89
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US71654QBG64 - Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-JUL-13 - 30-JAN-23 Επιτόκιο: 3.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ABXCN 4.1% 1/5/2023	680,0000	86,44293503	58.781,20
<ul style="list-style-type: none"> - 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: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
GLENCORE 1.75 17/3/2025	1.000,0000	91,09200000	91.092,00
<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: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
PORTEL4.5% 16/06/2025	500,0000	92,87500000	46.437,50
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS0221854200 - Εκδότης: PORTUGAL TELECOM INT FIN - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-JUN-05 - 16-JUN-25 Επιτόκιο: 4.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			495.101,25
ZERO COUPON			
BILHETES DO TESOIRO 18/12/2015	500,0000	99,95900000	49.979,50
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: PTPBTIGE0025 - Εκδότης: BILHETES DO TESOIRO - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-14 - 18-DEC-15 Επιτόκιο: 0% - Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA - Πρόσθετοι Όροι: 			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			49.979,50
ΣΥΝΟΛΟ II.2			545.080,75

3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ

GLOBO PLC -GBO LN	46.000,0000	0,72743885	33.462,19
NEWMONT MINING CORP	950,0000	20,87764769	19.833,77
ΣΥΝΟΛΟ II.3			53.295,96

4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

ZKB GOLD ETF	57,0000	1.018,19644293	58.037,20
SPROTT PHYSICAL GOLD TRUST	6.700,0000	8,63347931	57.844,31

ΣΥΝΟΛΟ II.4

ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II) **733.818,70**

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

1.266.787,07

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

142.903,78

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

1.409.690,85

III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EUR FX USD FUT SEP15	3,0000	1,11560000	373.894,00
----------------------	--------	------------	------------

ΣΥΝΟΛΟ III.1

373.894,00

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)

373.894,00

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

373.894,00

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