

GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

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	13.367,0100	0,10751763	1.437,19
CASH ACCOUNT IN GBP	2.373,0600	1,20992136	2.871,22
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			40.525,50
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			75.039,39
CASH ACCOUNT IN USD	63.409,2200	0,90073861	57.115,13
ΣΥΝΟΛΟ I.1			176.988,43
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	99,39500000	99.395,00
- 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: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	1.000,0000	103,49450000	103.494,50
- 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			202.889,50
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 5/8/2016	500,0000	99,75200000	49.876,00
- Isin: CY0146480815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-16 - 05-AUG-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 2/9/2016	500,0000	99,50900000	49.754,50
- Isin: CY0146530817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-16 - 02-SEP-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			99.630,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			302.520,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			479.508,43
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
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:			

BGB 1.25 22/6/2018	620,0000	103,62900000	64.249,98
<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: 			
MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019	1.000,0000	101,16100000	101.161,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1066486629 - Εκδότης: MOTOR OIL FINANCE PLC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-14 - 15-MAY-19 Επιτόκιο: 5.125% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA - Πρόσθετοι Όροι: 			
OTE PLC 4.375% 02/12/2019	1.000,0000	100,69200000	100.692,00
<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: 			
GAZPROM 3.6% 26/02/2021	1.000,0000	103,50000000	103.500,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1038646078 - Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA) - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-FEB-14 - 26-FEB-21 Επιτόκιο: 3.6% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ABXCN 4.1% 1/5/2023	680,0000	95,15402630	64.704,74
<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: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	6.600,0000	11,62459143	76.722,30
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: NO0010646813 - Εκδότης: NORWEGIAN KINGOM - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-MAY-12 - 24-MAY-23 Επιτόκιο: 2% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa - Πρόσθετοι Όροι: 			
ECOPETROL SA 18/9/2043	500,0000	89,36317781	44.681,59
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: US279158AE95 - Εκδότης: ECOPETROL SA - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-SEP-13 - 18-SEP-43 Επιτόκιο: 7.375% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			625.711,61
ΣΥΝΟΛΟ II.1			625.711,61
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	90,74410163	47.754,08
<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: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A - Πρόσθετοι Όροι: 			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			47.754,08

ΣΥΝΟΛΟ II.2			47.754,08
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLOBO PLC -GBO LN	46.000,0000	0,01209921	556,56
ΣΥΝΟΛΟ II.3			556,56
4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	11.232,3200	0,90073861	10.117,38
ΣΥΝΟΛΟ II.4			10.117,38
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
POWERSHARES DB PREC METALS	3.200,0000	36,87623852	118.003,96
ΣΥΝΟΛΟ II.5			118.003,96
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			802.143,59
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.281.652,02
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			10.833,11
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.292.485,13
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			0,00

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