

GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN GBP	0,2000	1,35409614	0,27
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			55.040,08
CASH ACCOUNT IN USD	9.213,7500	0,89261805	8.224,36
ΣΥΝΟΛΟ I.1			63.264,71
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.75 25/6/2019	1.200,0000	106,29750000	127.557,00
- 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	101,92050000	101.920,50
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			229.477,50
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 06/11/2015	500,0000	99,71250000	49.856,25
- Isin: CY0145890816			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-AUG-15 - 06-NOV-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			49.856,25
ΣΥΝΟΛΟ I.2			279.333,75
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			342.598,46
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
MARGIN IN USD/BETA	11.232,3200	0,89261805	10.026,17
ΣΥΝΟΛΟ II.1			10.026,17
2. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
US TREASURY 31/5/2017	1.690,0000	89,33851424	150.982,09
- Isin: US9128285Y71			
- Εκδότης: US TREASURY N/B			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-MAY-12 - 31-MAY-17 Επιτόκιο: .625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: n/a			
- Πρόσθετοι Όροι:			
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	135,40961408	71.259,31
<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: 			
BGB 1.25 22/6/2018	620,0000	103,81600000	64.365,92
<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: 			
PPC FINANCE 1/5/2019	1.000,0000	81,36400000	81.364,00
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1063837741 - Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19 Επιτόκιο: 5.5% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC- - Πρόσθετοι Όροι: 			
PETROBRAS 5.375% 27/01/2021	550,0000	65,04954030	35.777,25
<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: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
VALE BZ 4.375% 11/1/2022	650,0000	79,15736856	51.452,29
<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	80,43738284	48.262,43
<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	79,80005356	54.264,04
<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: 			
GLENCORE 1.75 17/3/2025	1.000,0000	73,59900000	73.599,00
<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	58,75000000	29.375,00
<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: Baa2 - Πρόσθετοι Όροι: 			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			730.701,33

ZERO COUPON

BILHETES DO TESOURO 18/12/2015	500,0000	99,99700000	49.998,50
- Isin: PTPBTIGE0025			
- Εκδότης: BILHETES DO TESOURO			
- 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			49.998,50
ΣΥΝΟΛΟ II.2			780.699,83
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLOBO PLC -GBO LN	46.000,0000	0,54163846	24.915,37
NEWMONT MINING CORP	950,0000	14,34437204	13.627,15
ΣΥΝΟΛΟ II.3			38.542,52
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ETF SHORT AUD LONG USD	850,0000	41,83700794	35.561,46
ZKB GOLD ETF	57,0000	969,41890565	55.256,88
SPROTT PHYSICAL GOLD TRUST	6.700,0000	8,19423369	54.901,37
ΣΥΝΟΛΟ II.4			145.719,71
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			974.988,23
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.317.586,69
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			10.743,08
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.328.329,77

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