

**GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016**

Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN AUD	491,2900	0,68226786	335,19
CASH ACCOUNT IN NOK	13.367,0100	0,11127803	1.487,45
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			128.559,16
CASH ACCOUNT IN USD	116.040,9400	0,89597706	103.970,02
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			75.039,39
CASH ACCOUNT IN GBP	2.934,2700	1,16139972	3.407,86
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>312.799,07</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	101,92600000	101.926,00
- 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	106,45650000	106.456,50
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>208.382,50</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>208.382,50</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>521.181,57</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	700,0000	100,00000000	70.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17			Επιτόκιο: 6%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
MOTOROIL FINANCE 5.125 15/5/2019	1.000,0000	103,05900000	103.059,00
- 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	103,32000000	103.320,00
- 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: Caa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			

GAZPROM 3.6% 26/02/2021	1.000,0000	105,25000000	105.250,00
- 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	96,65800556	65.727,44
- 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	11,82685139	78.057,22
- 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:			
AUSTRALIAN GOVERNMENT 21/4/2024	700,0000	72,40226513	50.681,59
- Isin: AU3TB0000143			
- Εκδότης: AUSTRALIAN GOVERNMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-APR-12 - 21-APR-24 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>576.095,25</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.1</b>			<b>576.095,25</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	58,06998595	30.559,33
- Isin: GB00BBHXP512			
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>30.559,33</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>30.559,33</b>
<b>3. MARGIN</b>			
MARGIN IN USD/BETA	11.232,3200	0,89597706	10.063,90
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>10.063,90</b>
<b>4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ</b>			
POWERSHARES DB PREC METALS	3.200,0000	36,38562853	116.434,01
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.4</b>			<b>116.434,01</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)</b>			<b>733.152,49</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)</b>			<b>1.254.334,06</b>
<b>ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>16.791,72</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>1.271.125,78</b>
<b>ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)</b>			<b>0,00</b>

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