

**GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND**

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016**

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
<b>I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ</b>			
CASH ACCOUNT IN AUD	2.479,0800	0,68511921	1.698,47
CASH ACCOUNT IN CAD	2.626,9100	0,70482098	1.851,50
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			314.979,39
CASH ACCOUNT IN GBP	2.934,2700	1,16797870	3.427,16
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			265.589,86
CASH ACCOUNT IN RUB	162.576,1200	0,01555210	2.528,40
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.1</b>			<b>590.074,78</b>
<b>2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ</b>			
<b>FIXED</b>			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	101,87450000	101.874,50
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>101.874,50</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ I.2</b>			<b>101.874,50</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)</b>			<b>691.949,28</b>
<b>II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			
<b>1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ</b>			
<b>FIXED</b>			
EXPORT CANADA 08/8/2017	680,0000	68,97437654	46.902,58
- Isin: AU3CB0197572			
- Εκδότης: EXPORT DEVELOPMNT CANADA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-AUG-12 - 08-AUG-17	Επιτόκιο: 3.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	42.000,0000	1,58363919	66.512,85
- 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	104,29100000	104.291,00
- 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:			
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:			

ASTALDI SPA, 1/12/2020	1.000,0000	104,50000000	104.500,00
- Isin: XS1000393899			
- Εκδότης: ASTALDI SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-DEC-13 - 01-DEC-20 Επιτόκιο: 7.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- 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:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	1.000,0000	99,56500000	99.565,00
- 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:			
TORONTO DOM 22/12/2021	500,0000	72,41119256	36.205,60
- Isin: CA8911452R48			
- Εκδότης: TORONTO-DOMINION BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-DEC-14 - 22-DEC-21 Επιτόκιο: 2.621%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALE BZ 4.375% 11/1/2022	1.000,0000	93,44464472	93.444,64
- 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: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>706.671,67</b>
<b>FLOATING</b>			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.000,0000	97,57707997	97.577,08
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 4.6065%			
- Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FLOATING</b>			<b>97.577,08</b>
<b>STEPPED</b>			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	88,27600000	88.276,00
- 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: B3e			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
<b>ΣΥΝΟΛΟ STEPPED</b>			<b>88.276,00</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.1</b>			<b>892.524,75</b>

## 2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

### FIXED

GLOBO TECH 6% 20/6/2018	625,4457	49,42000000	30.909,53
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18			Επιτόκιο: 6%
- 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:			
<b>ΣΥΝΟΛΟ FIXED</b>			<b>37.509,53</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.2</b>			<b>37.509,53</b>
<b>3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ</b>			
QUALITY & RELIABILITY SA	13.488,0000	0,33100000	4.464,53
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.3</b>			<b>4.464,53</b>
<b>4. MARGIN</b>			
MARGIN IN USD/BETA	11.232,3200	0,94867660	10.655,84
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.4</b>			<b>10.655,84</b>
<b>5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ</b>			
POWERSHARES DB COMM.IND	7.070,0000	15,02703728	106.241,15
<b>ΣΥΝΟΛΟ II.5</b>			<b>106.241,15</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)</b>			<b>1.051.395,80</b>
<b>ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)</b>			<b>1.743.345,08</b>
<b>ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>10.282,40</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ</b>			<b>1.753.627,48</b>

**ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)**

**0,00**

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