

GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	167,0100	0,10621913	17,74
CASH ACCOUNT IN GBP	2.373,0600	1,26334407	2.997,99
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			95.759,61
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			75.039,39
CASH ACCOUNT IN USD	43.695,4100	0,87834870	38.379,81
ΣΥΝΟΛΟ I.1			212.194,54
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	97,78200000	97.782,00
- Isin: CY0146250812			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νία 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	103,21850000	103.218,50
- Isin: XS1314321941			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-15 - 04-NOV-25			Επιτόκιο: 4.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			201.000,50
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 6/5/2016	500,0000	99,71700000	49.858,50
- Isin: CY0146270810			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-16 - 06-MAY-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			49.858,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			250.859,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			463.053,54
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/νία 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	103,80400000	64.358,48
- Isin: BE0000329384			
- Εκδότης: BELGIUM KINGDOM			
- Ην/νία 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	99,08000000	99.080,00
- 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	99,38700000	99.387,00
- 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:			
ABXCN 4.1% 1/5/2023	680,0000	85,60649978	58.212,42
- 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	11,43693239	75.483,75
- Isin: NO0010646813			
- Εκδότης: NORWEGIAN KINGDOM			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-MAY-12 - 24-MAY-23 Επιτόκιο: 2%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CITIGROUP 28/1/2025	1.000,0000	101,50600000	101.506,00
- Isin: XS1173792059			
- Εκδότης: CITIGROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 28-JAN-25 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			568.027,65
ΣΥΝΟΛΟ II.1			568.027,65
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	75,80064431	39.890,09
- 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			39.890,09
ΣΥΝΟΛΟ II.2			39.890,09
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
GLOBO PLC -GBO LN	46.000,0000	0,01263344	581,14
ΣΥΝΟΛΟ II.3			581,14
4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	11.232,3200	0,87834870	9.865,89
ΣΥΝΟΛΟ II.4			9.865,89
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
POWERSHARES DB PREC METALS	3.200,0000	32,68335529	104.586,74
ΣΥΝΟΛΟ II.5			104.586,74
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			722.951,51
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.186.005,05
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			65.124,51
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.251.129,56

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

0,00

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