

GMM BLUE WATER INVESTMENTS BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	3,9700	0,10907147	0,43
CASH ACCOUNT IN CAD	2.626,9100	0,70101647	1.841,51
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			175.525,54
CASH ACCOUNT IN RUB	162.576,1200	0,01658017	2.695,54
CASH ACCOUNT IN GBP	2.943,0000	1,16886608	3.439,97
CASH ACCOUNT IN AUD	3.584,0800	0,71520526	2.563,35
ΣΥΝΟΛΟ I.1			186.066,34
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	1.000,0000	104,66650000	104.666,50
- 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:			
CYPRUS 9.25 19/1/2027	1.000,0000	106,75000000	106.750,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27	Επιτόκιο: 9.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			211.416,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			211.416,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			397.482,84
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	680,0000	71,84451438	48.854,27
- 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	1,68353423	70.708,44
- 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	102,66900000	102.669,00
- 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	105,00000000	105.000,00
- 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	106,75000000	106.750,00
- 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	100,51900000	100.519,00
- 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	72,48650543	36.243,25
- 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	880,0000	95,05658965	83.649,80
- 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: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OPAP 21/3/2022	600,0000	100,66000000	60.396,00
- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22 Επιτόκιο: 3.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			764.789,76
FLOATING			
GOLDMAN SACHS 15/11/2021	750,0000	94,56832850	70.926,25
- Isin: US38145GAF72			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21 Επιτόκιο: 2.209%			
- Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			

- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.000,0000	100,37788794	100.377,89
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.7696%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			171.304,14
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	93,50000000	93.500,00
- 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: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			93.500,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			1.029.593,90
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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			37.509,53
ΣΥΝΟΛΟ II.2			37.509,53
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
QUALITY & RELIABILITY SA	13.488,0000	0,19900000	2.684,11
LUKOIL PJSC-SPON ADR	400,0000	49,53699373	19.814,80
POSCO -SPON ADR	690,0000	60,33111963	41.628,47
LANXESS AG	590,0000	62,89000000	37.105,10
ABB LTD-REG	1.830,0000	21,90538519	40.086,85
NATIXIS	5.400,0000	5,77600000	31.190,40
ΣΥΝΟΛΟ II.3			172.509,73
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			4.993,80
MARGIN IN USD/BETA	11.999,2400	0,93536620	11.223,68
ΣΥΝΟΛΟ II.4			16.217,48
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
POWERSHARES DB COMM.IND	7.070,0000	14,22691984	100.584,32
ΣΥΝΟΛΟ II.5			100.584,32
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			1.356.414,96
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			1.753.897,80
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			11.216,44
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			1.765.114,24
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON CURRENCY			
EUR FX USD FUT JUN17	3,0000	1,07220000	376.087,36



- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

376.087,36

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

376.087,36

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

376.087,36

GMM GLOBAL MONEY MANAGERS LTD

Στασίνου 36, 2003 Λευκωσία, Κύπρος