

SOL GMM BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN USD	225.453,7300	0,87627059	197.558,47
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			156.259,73
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			142.929,28
ΣΥΝΟΛΟ I.1			496.747,48
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	3.000,0000	109,39450000	328.183,50
- 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	2.000,0000	108,30100000	216.602,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS PCL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27			Επιτόκιο: 9.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			544.785,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			544.785,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			1.041.532,98
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	11.400,0000	27,22154255	310.325,59
- Isin: XS1136802615			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-NOV-14 - 19-JUN-18			Επιτόκιο: 10%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BANCO DO BRAZIL, 25/7/2018 3.75%	2.500,0000	102,75000000	256.875,00
- Isin: XS0955552178			
- Εκδότης: BANCO DO BRASIL (CAYMAN)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUL-13 - 25-JUL-18			Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	240.000,0000	1,50366645	360.879,95
- 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:			
STATE BANK INDIA 17/4/2019	2.000,0000	89,17718191	178.354,36
- Isin: USY81647AA02			
- Εκδότης: STATE BANK INDIA/LONDON			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-APR-14 - 17-APR-19			Επιτόκιο: 3.622%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			

- Πρόσθετοι Όροι:			
NORWEGIAN GOV 22/5/2019	26.000,0000	11,20965804	291.451,11
- Isin: NO0010429913			
- Εκδότης: NORWEGIAN GOVERNMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAY-08 - 22-MAY-19	Επιτόκιο: 4.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SBERBANK OF RUSSIA 28/062019	2.000,0000	91,68068700	183.361,37
- Isin: XS0799357354			
- Εκδότης: SBERBANK (SB CAP SA)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JUN-12 - 28-JUN-19	Επιτόκιο: 5.18%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE 3.5% 09/07/2020	1.000,0000	103,84000000	103.840,00
- Isin: XS1086785182			
- Εκδότης: OTE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-JUL-14 - 09-JUL-20	Επιτόκιο: 3.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	1.500,0000	100,00000000	150.000,00
- 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:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	2.000,0000	91,92954784	183.859,10
- Isin: USG3925DAA84			
- Εκδότης: GERDAU TRADE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21	Επιτόκιο: 5.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	93,73817035	140.607,26
- Isin: US040114GW47			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-16 - 22-APR-21	Επιτόκιο: 6.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	3.000,0000	106,00600000	318.018,00
- Isin: XS1405774727			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-SEP-16 - 15-SEP-21	Επιτόκιο: 6.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	3.000,0000	105,21600000	315.648,00
- 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:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/1/2022	1.500,0000	99,69800000	149.547,00
- Isin: XS1503160225			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-22	Επιτόκιο: 3.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			

- Πρόσθετοι Όροι:			
DEHLI INT AIRPORT 3/2/2022	2.000,0000	93,83631265	187.672,63
- Isin: XS1165980274			
- Εκδότης: DELHI INTERNATIONAL AIRP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-15 - 03-FEB-22	Επιτόκιο: 6.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GASLOG 8.875 22/3/2022	1.000,0000	92,54293726	92.542,94
- Isin: USG37585AC37			
- Εκδότης: GASLOG LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-17 - 22-MAR-22	Επιτόκιο: 8.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BRF 3/6/2022	2.000,0000	100,77300000	201.546,00
- Isin: XS1242327168			
- Εκδότης: BRF SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-15 - 03-JUN-22	Επιτόκιο: 2.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SYSTEMS SUNLIGHT ABEE 20/6/2022	1.170,0000	100,65000000	117.760,50
- Isin: GRC8121176B9			
- Εκδότης: SYSTEMS SUNLIGHT ABEE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-17 - 20-JUN-22	Επιτόκιο: 4.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ 6/22 3.1%	1.910,0000	100,31000000	191.592,10
- Isin: GRC3931176B0			
- Εκδότης: MYTILINEOS HOLDINGS S.A.			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-17 - 26-JUN-22	Επιτόκιο: 3.1%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS ARGENTINA 21/7/2023	1.000,0000	92,44567122	92.445,67
- Isin: USP7873PAE62			
- Εκδότης: PETROBRAS ARGENTINA SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUL-16 - 21-JUL-23	Επιτόκιο: 7.375%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS 4.75% 14/01/2025	2.000,0000	102,28200000	204.564,00
- Isin: XS0982711714			
- Εκδότης: PETROBRAS GLOBAL FINANCE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JAN-14 - 14-JAN-25	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ASSICURAZIONI GENERALI 4/5/2026	2.000,0000	108,23200000	216.464,00
- Isin: XS1062900912			
- Εκδότης: ASSICURAZIONI GENERALI			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-MAY-14 - 04-MAY-26	Επιτόκιο: 4.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 10/2/2027	2.000,0000	107,44100000	214.882,00
- Isin: XS1562614831			
- Εκδότης: BANCO BILBAO VIZCAYA ARG			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-FEB-17 - 10-FEB-27	Επιτόκιο: 3.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			

- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.462.236,58
FLOATING			
GOLDMAN SACHS 15/11/2021	2.000,0000	88,42271293	176.845,43
- Isin: US38145GAF72			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21	Επιτόκιο: 2.3518%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.600,0000	94,53645286	151.258,32
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.8781%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			328.103,75
ZERO COUPON			
GTB 0 08/09/17	3.000,0000	99,57900000	298.737,00
- Isin: GR0000167701			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-JUN-17 - 08-SEP-17	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GTB 0 15/9/17	1.000,0000	99,53400000	99.534,00
- Isin: GR0000168717			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-JUN-17 - 15-SEP-17	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: C			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			398.271,00
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	2.000,0000	93,44900000	186.898,00
- 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			
GGB 3% 24/2/27	3.000,0000	88,11500000	264.345,00
- Isin: GR0128014710			
- Εκδότης: HELLENIC REPUBLIC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-FEB-12 - 24-FEB-27	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			451.243,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			
			5.639.854,33
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	5.966,7519	46,62000000	278.169,97
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18	Επιτόκιο: 0%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CELTONA LTD 15/12/2019	589,0000	100,00000000	58.900,00
- Isin:			

- Εκδότης: CELTONA LTD
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-16 - 15-DEC-19 Επιδόκιο: 3%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:
- Πρόσθετοι Όροι:

ΣΥΝΟΛΟ FIXED			337.069,97
ΣΥΝΟΛΟ II.2			337.069,97
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
QUALITY & RELIABILITY SA	121.391,0000	0,19000000	23.064,29
PUBLIC POWER CORP.	37.500,0000	2,19000000	82.125,00
A.D.M.H.E. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε.	37.500,0000	2,24000000	84.000,00
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	8.750,0000	12,09253417	105.809,67
LUKOIL PJSC-SPON ADR	2.600,0000	42,67437785	110.953,38
GEK GROUP OF COMPANIES S.A.	45.500,0000	4,06000000	184.730,00
LANXESS AG	1.950,0000	66,29000000	129.265,50
DEUTSCHE BANK AG	8.600,0000	15,52500000	133.515,00
ΤΡΑΠΕΖΑ ΠΕΙΡΑΙΩΣ	630.000,0000	0,21500000	135.450,00
MYTILINEOS HOLDINGS S.A.	21.700,0000	8,26000000	179.242,00
ING GROUP NV	7.800,0000	15,10000000	117.780,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			1.285.934,84
4. MARGIN			
MARGIN CLASS 1 IN EURO			58.164,24
MARGIN IN USD/BETA	171.945,8700	0,87627059	150.671,11
ΣΥΝΟΛΟ II.4			208.835,35
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	14.550,0000	24,73273747	359.861,33
ΣΥΝΟΛΟ II.5			359.861,33
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			7.831.555,82
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			8.873.088,80
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			741.976,99
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			9.615.065,79
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON CURRENCY			
EURO FX USD CURR FUT SEP17	15,0000	1,14670000	1.884.036,54
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			1.884.036,54
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			1.884.036,54
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			1.884.036,54

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