

SOL GMM BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2015

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	17.572,8500	0,89373492	15.705,47
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			949.991,92
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.769.330,82
CASH ACCOUNT IN GBP	78.278,9350	1,40567894	110.035,05
ΣΥΝΟΛΟ I.1			2.845.063,26
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.75 1/11/2015	2.500,0000	99,77300000	249.432,50
- Isin: XS0554655505			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-NOV-10 - 01-NOV-15			Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4.75 25/6/2019	2.000,0000	103,36000000	206.720,00
- Isin: XS1081101807			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUN-14 - 25-JUN-19			Επιτόκιο: 4.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	2.000,0000	100,19800000	200.396,00
- Isin: XS1227247191			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-15 - 06-MAY-22			Επιτόκιο: 3.875%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			656.548,50
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 08/7/2015	2.000,0000	99,90600000	199.812,00
- Isin: CY0145640815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-APR-15 - 08-JUL-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 17/7/2015	7.000,0000	99,80100000	698.607,00
- Isin: CY0145780819			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-JUN-15 - 17-JUL-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 07/8/2015	2.000,0000	99,55900000	199.118,00
- Isin: CY0145700817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-15 - 07-AUG-15			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			

CYPRUS TBILL 4/9/2015	2.000,0000	99,23800000	198.476,00
- Isin: CY0145760811			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-JUN-15 - 04-SEP-15 Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			1.296.013,00
ΣΥΝΟΛΟ Ι.2			1.952.561,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (Ι)			4.797.624,76
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
MARGIN IN GBP/BETA	30.577,6400	1,40567894	42.982,34
MARGIN IN USD/BETA	35.474,0400	0,89373492	31.704,39
ΣΥΝΟΛΟ II.1			74.686,73
2. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 7.45	2.100,0000	100,00000000	210.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17 Επιτόκιο: 7.45%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
STATE BANK INDIA 1/8/2017	2.300,0000	92,81347752	213.471,00
- Isin: USU85528AB04			
- Εκδότης: STATE BANK INDIA/LONDON			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-AUG-12 - 01-AUG-17 Επιτόκιο: 4.125%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
KONINKLIJKE 11/3/2018	1.600,0000	98,05076414	156.881,22
- Isin: US500472AB13			
- Εκδότης: KONINKLIJKE PHILIPS NV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-MAR-08 - 11-MAR-18 Επιτόκιο: 5.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	4.736,2500	140,56789429	665.764,69
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18 Επιτόκιο: 9%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
RENAULT S .A 3.625 19/9/2018	3.000,0000	107,75000000	323.250,00
- Isin: FR0011568963			
- Εκδότης: RENAULT SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-SEP-13 - 19-SEP-18 Επιτόκιο: 3.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
KOF 2.375% 26/11/2018	3.000,0000	90,80614890	272.418,45
- Isin: US191241AG32			
- Εκδότης: COCA-COLA FEMSA SAB CV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-NOV-13 - 26-NOV-18 Επιτόκιο: 2.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2			
- Πρόσθετοι Όροι:			

BHARTI 4 10/12/18	1.500,0000	107,00300000	160.504,50
- Isin: XS0997979249			
- Εκδότης: BHARTI AIRTEL INTERNATIO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-DEC-13 - 10-DEC-18 Επιτόκιο: 4%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BAO TRANS ENTERE 12/12/2018	3.500,0000	91,61408526	320.649,30
- Isin: XS1001851994			
- Εκδότης: BAO-TRANS ENTERPRISE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-DEC-13 - 12-DEC-18 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	1.000,0000	102,62500000	102.625,00
- Isin: XS0982710153			
- Εκδότης: PLAY FINANCE 2 SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JAN-14 - 01-FEB-19 Επιτόκιο: 5.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PORTEL 5% 4/11/2019	1.900,0000	101,75000000	193.325,00
- Isin: XS0462994343			
- Εκδότης: PORTUGAL TELECOM INT FIN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-NOV-09 - 04-NOV-19 Επιτόκιο: 5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL 02/12/2019	2.000,0000	100,08000000	200.160,00
- Isin: XS1147600305			
- Εκδότης: GLAXOSMITHKLINE CAPITAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 02-DEC-14 - 02-DEC-19 Επιτόκιο: .625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GOLDMAN SACHS 19/8/2020	1.000,0000	106,59200000	106.592,00
- Isin: XS0963375232			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-AUG-13 - 19-AUG-20 Επιτόκιο: 2.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SINOPEC 17/10/2020	1.000,0000	107,03400000	107.034,00
- Isin: XS0982303785			
- Εκδότης: SINOPEC GRP OVERSEA 2013			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-OCT-13 - 17-OCT-20 Επιτόκιο: 2.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ORLEN CAPITAL AB 30/6/2021	2.000,0000	100,27400000	200.548,00
- Isin: XS1082660744			
- Εκδότης: ORLEN CAPITAL AB			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-JUN-14 - 30-JUN-21 Επιτόκιο: 2.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
JPM 1.375% 16/9/2021	1.000,0000	100,09300000	100.093,00
- Isin: XS1110449458			
- Εκδότης: JPMORGAN CHASE & CO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-SEP-14 - 16-SEP-21 Επιτόκιο: 1.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			

SODEXO 24/1/2022	2.000,0000	102,65100000	205.302,00
- Isin: XS1080163709			
- Εκδότης: SODEXO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-JUN-14 - 24-JAN-22 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VESTAS WIND 11/3/2022	2.000,0000	96,06000000	192.120,00
- Isin: XS1197336263			
- Εκδότης: VESTAS WIND SYSTEMS A/S			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 11-MAR-15 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BARCLAYS BANK 30/3/2022	1.000,0000	123,79100000	123.791,00
- Isin: XS0611398008			
- Εκδότης: BARCLAYS BANK PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 30-MAR-11 - 30-MAR-22 Επιτόκιο: 6.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SLB 2.4% 1/8/2022	3.000,0000	85,35704710	256.071,14
- Isin: USL81445AD75			
- Εκδότης: SCHLUMBERGER INVESTMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-JUL-12 - 01-AUG-22 Επιτόκιο: 2.4%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VMED 15/1/2025	1.000,0000	99,37500000	99.375,00
- Isin: XS1169920193			
- Εκδότης: VIRGIN MEDIA FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JAN-15 - 15-JAN-25 Επιτόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CITIGROUP 28/1/2025	2.000,0000	96,53300000	193.066,00
- 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:			
SOCIETE GENERALE 27/2/2025	1.000,0000	93,33200000	93.332,00
- Isin: XS1195574881			
- Εκδότης: SOCIETE GENERALE SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-FEB-15 - 27-FEB-25 Επιτόκιο: 2.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GLENCORE 1.75 17/3/2025	2.000,0000	91,09200000	182.184,00
- Isin: XS1202849086			
- Εκδότης: GLENCORE FINANCE EUROPE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-15 - 17-MAR-25 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.678.557,30

ZERO COUPON

BILHETES DO TESOURO 18/12/2015	2.000,0000	99,95900000	199.918,00
- Isin: PTPBTIG0025			
- Εκδότης: BILHETES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-14 - 18-DEC-15			
Επιτόκιο: 0%			
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			
Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			

ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON **199.918,00**

ΣΥΝΟΛΟ II.2 **4.878.475,30**

ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II) **4.953.162,03**

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) **9.750.786,79**

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ **-10.843,40**

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ **9.739.943,39**

III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY

EURO FX GBP CURR FUT sep15	5,0000	0,70945000	623.286,83
EUR FX USD FUT SEP15	5,0000	1,11560000	623.156,67

ΣΥΝΟΛΟ III.1 **1.246.443,50**

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (III) **1.246.443,50**

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV) **1.246.443,50**

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