

SOL GMM BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Β

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	115.276,6000	0,10751763	12.394,27
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.715.630,57
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			400.221,87
CASH ACCOUNT IN GBP	21.412,8200	1,20992136	25.907,83
ΣΥΝΟΛΟ I.1			2.154.154,54
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	1.240,0000	99,71050000	123.641,02
- Isin: CY0146220815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18			Επιτόκιο: 2%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 06/5/2022	2.000,0000	102,61250000	205.225,00
- Isin: XS1227247191			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-15 - 06-MAY-22			Επιτόκιο: 3.875%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	3.000,0000	99,39500000	298.185,00
- 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	3.000,0000	103,49450000	310.483,50
- 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			937.534,52
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 5/8/2016	3.000,0000	99,75200000	299.256,00
- Isin: CY0146480815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-16 - 05-AUG-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS TBILL 2/9/2016	4.000,0000	99,50900000	398.036,00
- Isin: CY0146530817			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-16 - 02-SEP-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			697.292,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			1.634.826,52
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			3.788.981,06

II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΓΑ

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:			
BAO TRANS ENTERPRICE	2.000,0000	100,02600000	200.052,00
- Isin: XS1181873776			
- Εκδότης: BAO-TRANS ENTERPRISE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-FEB-15 - 23-FEB-18 Επιτόκιο: 1.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
KONINKLIJKE 11/3/2018	1.600,0000	96,31687984	154.107,01
- 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:			
BGB 1.25 22/6/2018	3.500,0000	103,62900000	362.701,50
- Isin: BE0000329384			
- Εκδότης: BELGIUM KINGDOM			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-FEB-13 - 22-JUN-18 Επιτόκιο: 1.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: AA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
IRISH 4.5% 18/10/2018	4.000,0000	111,16000000	444.640,00
- Isin: IE00B28HXX02			
- Εκδότης: IRISH TSY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-OCT-07 - 18-OCT-18 Επιτόκιο: 4.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BHARTI 4 10/12/18	1.500,0000	107,13600000	160.704,00
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	1.000,0000	102,12500000	102.125,00
- 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:			
GENERAL MOT. 15/10/2019	1.000,0000	103,87500000	103.875,00
- Isin: XS1121198094			
- Εκδότης: GENERAL MOTORS FINANCIAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-OCT-14 - 15-OCT-19 Επιτόκιο: 1.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIRELLI INT 18/11/2019	1.000,0000	99,63600000	99.636,00
- Isin: XS1139287350			
- Εκδότης: PIRELLI INTERNATIONAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-NOV-14 - 18-NOV-19 Επιτόκιο: 1.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			

OTE PLC 4.375% 02/12/2019	2.000,0000	100,69200000	201.384,00
- 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:			
OTE 3.5% 09/07/2020	1.000,0000	97,84900000	97.849,00
- 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:			
ANADARKO PETR. 15/3/2021	2.000,0000	95,47739146	190.954,78
- Isin: US032511BM81			
- Εκδότης: ANADARKO PETROLEUM CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-MAR-16 - 15-MAR-21 Επιτόκιο: 4.85%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIAGIM 4.625 30/4/2021	2.000,0000	102,87500000	205.750,00
- Isin: XS1061086846			
- Εκδότης: PIAGGIO & C SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-APR-14 - 30-APR-21 Επιτόκιο: 4.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BHARTI 3.375 20/05/21	1.500,0000	107,89400000	161.841,00
- Isin: XS1028954953			
- Εκδότης: BHARTI AIRTEL INTERNATIO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-MAY-14 - 20-MAY-21 Επιτόκιο: 3.375%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
THOMAS COOK 15/6/2021	1.000,0000	92,37500000	92.375,00
- Isin: XS1172436211			
- Εκδότης: THOMAS COOK FINANCE PLC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 23-JAN-15 - 15-JUN-21 Επιτόκιο: 6.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ORLEN CAPITAL AB 30/6/2021	2.000,0000	102,02600000	204.052,00
- 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:			
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022	18.000,0000	11,01432135	198.257,78
- Isin: XS1227593933			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-MAY-15 - 12-MAY-22 Επιτόκιο: 1.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
MMC NORLISK NICKEL 14/10/2022	2.000,0000	99,86939290	199.738,79
- Isin: XS1298447019			
- Εκδότης: MMC NORILSK NICK VIA MMC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-15 - 14-OCT-22 Επιτόκιο: 6.625%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			

ABXCN 4.1% 1/5/2023	2.000,0000	95,15402630	190.308,05
- 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	41.500,0000	11,62459143	482.420,54
- 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:			
CODELCO INC 9/7/2024	1.500,0000	97,91600000	146.874,00
- Isin: XS1084942470			
- Εκδότης: CODELCO INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 09-JUL-14 - 09-JUL-24 Επιτόκιο: 2.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.209.645,45
ΣΥΝΟΛΟ II.1			4.209.645,45
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	4.736,2500	90,74410163	429.786,75
- 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			429.786,75
ΣΥΝΟΛΟ II.2			429.786,75
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
SILVER WHEATON CORP	12.500,0000	21,19437939	264.929,74
ΣΥΝΟΛΟ II.3			264.929,74
4. MARGIN			
MARGIN IN USD/BETA	31.643,9100	0,90073861	28.502,89
MARGIN CLASS 1 IN EURO			12.730,33
MARGIN IN GBP/BETA	28.825,0000	1,20992136	34.875,98
ΣΥΝΟΛΟ II.4			76.109,20
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ISHARES SILVER TRUST	13.700,0000	16,09169519	220.456,22
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	6.800,0000	51,30000000	348.840,00
DBX STX EUROPE BANKS SHORT	13.000,0000	25,38000000	329.940,00
ΣΥΝΟΛΟ II.5			899.236,22
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			5.879.707,36
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			9.668.688,42
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			69.561,78
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			9.738.250,20
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EURO FX GBP CURR sep16	4,0000	0,83845000	507.229,28
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			507.229,28
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			507.229,28
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			507.229,28