

SOL GMM BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016
Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN AUD	213,9100	0,68226786	145,94
CASH ACCOUNT IN GBP	26.463,6800	1,16139972	30.734,91
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.773.758,09
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			1.900.166,87
CASH ACCOUNT IN USD	112.122,8300	0,89597706	100.459,48
ΣΥΝΟΛΟ I.1			3.805.265,29
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	1.240,0000	100,80850000	125.002,54
- Isin: CY0146220815			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-18			Επιτόκιο: 2%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	3.000,0000	101,92600000	305.778,00
- 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: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.75 26/7/2023	1.400,0000	103,16950000	144.437,30
- Isin: XS1457553367			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUL-16 - 26-JUL-23			Επιτόκιο: 3.75%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	3.000,0000	106,45650000	319.369,50
- Isin: XS1314321941			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-15 - 04-NOV-25			Επιτόκιο: 4.25%
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			894.587,34
ZERO COUPON			
CYPRUS T-BILL 07/10/2016	1.000,0000	99,98500000	99.985,00
- Isin: CY0146570813			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUL-16 - 07-OCT-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 4/11/2016	1.500,0000	99,84900000	149.773,50
- Isin: CY0146620816			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-AUG-16 - 04-NOV-16			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			249.758,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			1.144.345,84
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			4.949.611,13

II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ

FIXED

Q & R UK LTD 21/7/2017 6	2.100,0000	100,00000000	210.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BAO TRANS ENTERPRICE	2.000,0000	101,04500000	202.090,00
- 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	95,05689454	152.091,03
- 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:			
BHARTI 4 10/12/18	1.500,0000	107,53300000	161.299,50
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	1.000,0000	102,37500000	102.375,00
- 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:			
PIRELLI INT 18/11/2019	2.000,0000	100,82800000	201.656,00
- 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 3.5% 09/07/2020	1.000,0000	101,02900000	101.029,00
- 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	96,44117911	192.882,36
- 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: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	97,57279814	146.359,20
- Isin: USPO4808AA23			
- 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:			

PIAGIM 4.625 30/4/2021	2.000,0000	103,50000000	207.000,00
- 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:			
REPUBLIC OF INDONESIA 8/7/2021	3.000,0000	106,86800000	320.604,00
- Isin: XS1084368593			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-JUL-14 - 08-JUL-21 Επιτόκιο: 2.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000	100,12900000	100.129,00
- 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:			
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022	18.000,0000	11,28092138	203.056,58
- 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:			
ABXCN 4.1% 1/5/2023	2.000,0000	96,65800556	193.316,01
- 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	20.700,0000	11,82685139	244.815,82
- 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:			
AUSTRALIAN GOVERNMENT 21/4/2024	6.360,0000	72,40226513	460.478,41
- Isin: AU3TB0000143			
- Εκδότης: AUSTRALIAN GOVERNMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-APR-12 - 21-APR-24 Επιτόκιο: 2.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
KINDER MORGAN/DELAWA 16/3/2027	2.000,0000	100,95100000	201.902,00
- Isin: XS1196817586			
- Εκδότης: KINDER MORGAN INC /DELAWA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 16-MAR-15 - 16-MAR-27 Επιτόκιο: 2.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή:			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			3.401.083,91

ΣΥΝΟΛΟ II.1

3.401.083,91

2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ

FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	4.736,2500	58,06998595	275.033,97
- 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			275.033,97
ΣΥΝΟΛΟ II.2			275.033,97
3. MARGIN			
MARGIN IN GBP/BETA	61.215,0000	1,16139972	71.095,08
MARGIN IN USD/BETA	13.394,4600	0,89597706	12.001,13
ΣΥΝΟΛΟ II.3			83.096,21
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
ETFS PRECIOUS METALS	6.050,0000	16,23500000	98.221,75
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	11.050,0000	49,22000000	543.881,00
ISHARES EM ASIA MLCL GOV BND	2.900,0000	85,84000000	248.936,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			891.038,75
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			4.650.252,84
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			9.599.863,97
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			61.577,39
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			9.661.441,36

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES ON CURRENCY			
EURO FX GBP CURR FUT DEC16	2,0000	0,86765000	251.922,12
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			251.922,12
2. OPTIONS ON STOCKS			
OPTION DAX 12/16/16	85,0000	13,90000000	5.907,50
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT Χώρα: GERMANY			
ΣΥΝΟΛΟ IV.2			5.907,50
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			257.829,62
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			257.829,62

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