

SOL GMM BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Δ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN AUD	11.634,3400	0,68511921	7.970,91
CASH ACCOUNT IN CAD	12.917,9700	0,70482098	9.104,86
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			899.956,87
CASH ACCOUNT IN RUB	1.325.900,3200	0,01555210	20.620,53
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			686.637,06
CASH ACCOUNT IN USD	15.426,4600	0,94867660	14.634,72
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.638.924,95
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	3.000,0000	101,87450000	305.623,50
- 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 3.75 26/7/2023	1.400,0000	102,44800000	143.427,20
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	1.000,0000	105,69450000	105.694,50
- 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: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			554.745,20
ZERO COUPON			
CYPRUS TBILL 9/1/2017	1.000,0000	99,98400000	99.984,00
- Isin: CY0146800814			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-OCT-16 - 09-JAN-17			Επιτόκιο: 0%
- Τύπος Επιτοκίου: Zero Coupon			Πηγή: BLOOMBERG
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ ZERO COUPON			99.984,00
ΣΥΝΟΛΟ I.2			654.729,20
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.293.654,15
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	6.250,0000	68,97437654	431.089,85
- 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:			

BAO TRANS ENTERPRICE	2.000,0000	100,97800000	201.956,00
- 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:			
BHARTI 4 10/12/18	1.500,0000	106,94200000	160.413,00
- 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:			
INTL FINANCE 17/12/2018	120.000,0000	1,58363919	190.036,70
- 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:			
PFOURS 5.25 1/2/2019	1.000,0000	101,75000000	101.750,00
- 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:			
STATE BANK INDIA 17/4/2019	2.000,0000	97,09040888	194.180,82
- 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:			
PPC FINANCE 1/5/2019	2.000,0000	86,68200000	173.364,00
- Isin: XS1063837741			
- Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19 Επιτόκιο: 5.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SBERBANK OF RUSSIA 28/062019	2.000,0000	99,01811972	198.036,24
- Isin: XS0799357354			
- Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 28-JUN-12 - 28-JUN-19 Επιτόκιο: 5.18%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIRELLI INT 18/11/2019	2.000,0000	101,31500000	202.630,00
- 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	102,13300000	102.133,00
- 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
<ul style="list-style-type: none"> - 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	2.000,0000	104,50000000	209.000,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
GERDAU TRADE 30/1/2021	2.000,0000	97,47652025	194.953,04
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: USG3925DAA84 - Εκδότης: GERDAU TRADE INC - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21 Επιτόκιο: 5.75% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB- - Πρόσθετοι Όροι: 			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	101,30158429	151.952,38
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: USP04808AA23 - 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
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	3.000,0000	101,45000000	304.350,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	99,56500000	298.695,00
<ul style="list-style-type: none"> - 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	5.200,0000	72,41119256	376.538,20
<ul style="list-style-type: none"> - 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: 			
DEHLI INT AIRPORT 3/2/2022	2.000,0000	100,32255004	200.645,10
<ul style="list-style-type: none"> - Isin: XS1165980274 - Εκδότης: DELHI INTERNATIONAR AIRPORT - Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-FEB-15 - 03-FEB-22 Επιτόκιο: 6.125% - Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG - Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2 - Πρόσθετοι Όροι: 			

NOVATEK 13/12/2022	2.000,0000	93,91898302	187.837,97
- Isin: XS0864383723			
- Εκδότης: NOVATEK FIN LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-12 - 13-DEC-22 Επιτόκιο: 4.422%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALE 3.75% 10/1/2023	2.000,0000	105,25000000	210.500,00
- Isin: XS0802953165			
- Εκδότης: VALE OVERSEAS LIMITED			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 10-JUL-12 - 10-JAN-23 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028	3.000,0000	102,01500000	306.045,00
- Isin: XS1432493440			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JUN-16 - 14-JUN-28 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			4.753.106,30
FLOATING			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.600,0000	97,57707997	156.123,33
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22 Επιτόκιο: 4.6065%			
- Τύπος Επιτοκίου: Floating Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			156.123,33
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	2.000,0000	88,27600000	176.552,00
- 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: B3e			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			176.552,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			
5.085.781,63			
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	5.629,0112	49,42000000	278.185,73
- 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	589,0000	100,00000000	58.900,00
- 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			337.085,73
ΣΥΝΟΛΟ II.2			
337.085,73			

3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ

QUALITY & RELIABILITY SA	121.391,0000	0,33100000	40.180,42
GLENCORE XSTRATA PLC	39.700,0000	3,23938891	128.603,74
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	8.750,0000	15,92828005	139.372,45
MYTILINEOS HOLDINGS S.A.	32.500,0000	6,15000000	199.875,00
PUBLIC POWER CORP.	57.800,0000	2,89000000	167.042,00
GREEK ORGN OF FOOTBALL.SA	21.300,0000	8,40000000	178.920,00
NOVATEK OAO SPONS GDR	1.240,0000	123,13822218	152.691,40

ΣΥΝΟΛΟ II.3

1.006.685,01

4. MARGIN

MARGIN CLASS 1 IN EURO			50.005,68
MARGIN IN USD/BETA	40.065,7700	0,94867660	38.009,46

ΣΥΝΟΛΟ II.4

88.015,14

5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

PROSHARES SHORT 7-10YR	14.550,0000	27,57793378	401.258,94
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	18.450,0000	16,81000000	310.144,50

ΣΥΝΟΛΟ II.5

711.403,44

ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)

7.228.970,95

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

9.522.625,10

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

55.550,53

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

9.578.175,63

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES

EURO-BUND FUT MAR 17	4,0000	164,15000000	656.600,00
----------------------	--------	--------------	------------

- Χρηματιστήριο: FRANKFURT Χώρα: GERMANY

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

656.600,00

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

656.600,00

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

656.600,00

GMM GLOBAL MONEY MANAGERS LTD

Στασίνου 36, 2003 Λευκωσία, Κύπρος