

SOL GMM BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN NOK	3.683,5800	0,10621913	391,27
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			296,87
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			1.799.586,06
CASH ACCOUNT IN USD	34.191,4700	0,87834870	30.032,03
CASH ACCOUNT IN GBP	21.412,8200	1,26334407	27.051,76
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.857.357,99
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 2 18/1/2018	1.240,0000	98,45500000	122.084,20
- 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 06/5/2022	2.000,0000	102,42250000	204.845,00
- 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:			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	3.000,0000	97,78200000	293.346,00
- 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:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	4.500,0000	103,21850000	464.483,25
- 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			1.084.758,45
ΣΥΝΟΛΟ I.2			1.084.758,45
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			2.942.116,44
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΣ- 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:			
KONINKLIJKE 11/3/2018	1.600,0000	94,08256478	150.532,10
- 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	103,80400000	363.314,00
- 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	112,17800000	448.712,00
- 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: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BHARTI 4 10/12/18	1.500,0000	107,28300000	160.924,50
- 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	102,50000000	102.500,00
- 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:			
HELLENIC PETROLEUM 5.25% 04/07/19	1.000,0000	87,89500000	87.895,00
- Isin: XS1083287547			
- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-JUL-14 - 04-JUL-19 Επιτόκιο: 5.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
VALLOUREC SA 2/8/2019	1.000,0000	85,25000000	85.250,00
- Isin: FR0011302793			
- Εκδότης: VALLOUREC SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-AUG-12 - 02-AUG-19 Επιτόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GENERAL MOT. 15/10/2019	1.000,0000	102,50000000	102.500,00
- 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:			
SBERBANK OF RUSSIA 15/11/2019	2.000,0000	100,25000000	200.500,00
- Isin: XS1082459568			
- Εκδότης: SBERBANK OF RUSSIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUN-14 - 15-NOV-19 Επιτόκιο: 3.3524%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIRELLI INT 18/11/2019	1.000,0000	97,03300000	97.033,00
- 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	99,38700000	198.774,00
- 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:			
INTERNATIONAL GAME TECH	1.000,0000	103,62500000	103.625,00
- Isin: XS0860855930			
- Εκδότης: INTERNATIONAL GAME TECH			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-12 - 05-MAR-20 Επιτόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GAZPROM 3.389% 20/03/2020	2.500,0000	99,87500000	249.687,50
- Isin: XS0906946008			
- Εκδότης: GAZPROM (GAZ CAPITAL SA)			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-13 - 20-MAR-20 Επιτόκιο: 3.389%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OTE 3.5% 09/07/2020	1.000,0000	95,95900000	95.959,00
- 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:			
OI EUROPEAN GROUP BV	1.000,0000	109,25000000	109.250,00
- Isin: XS0908230781			
- Εκδότης: OI EUROPEAN GROUP BV			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-13 - 31-MAR-21 Επιτόκιο: 4.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIAGIM 4.625 30/4/2021	2.000,0000	103,62500000	207.250,00
- 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	106,90800000	160.362,00
- 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	100,50000000	100.500,00
- 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	100,87900000	201.758,00
- 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	103,15000000	103.150,00
- 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:			
VESTAS WIND 11/3/2022	2.000,0000	101,09800000	202.196,00
- 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:			
BRF 3/6/2022	2.000,0000	92,59700000	185.194,00
- 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: Baa2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SLB 2.4% 1/8/2022	3.000,0000	85,27975406	255.839,26
- 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:			
MMC NORLISK NICKEL 14/10/2022	2.000,0000	92,00702679	184.014,05
- 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:			
CARNIVAL CORP 7/11/2022	1.000,0000	102,40800000	102.408,00
- Isin: XS1317305198			
- Εκδότης: CARNIVAL CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-NOV-15 - 07-NOV-22 Επιτόκιο: 1.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
TEVA 31/3/203	2.000,0000	97,91500000	195.830,00
- Isin: XS1211040917			
- Εκδότης: TEVA PHARM FNC NL II			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 31-MAR-15 - 31-MAR-23 Επιτόκιο: 1.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	41.500,0000	11,43693239	474.632,69
- 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	95,16300000	142.744,50
- 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:			

FERROVIAL EM. 15/7/2024	1.000,0000	107,58000000	107.580,00
- Isin: ES0205032008			
- Εκδότης: FERROVIAL SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-JUL-14 - 15-JUL-24 Επιτόκιο: 2.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CITIGROUP 28/1/2025	3.000,0000	101,50600000	304.518,00
- 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:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			5.694.432,60
ΣΥΝΟΛΟ II.1			5.694.432,60
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	4.736,2500	75,80064431	359.010,80
- Isin: GB00BBHXP512			
- 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			359.010,80
ΣΥΝΟΛΟ II.2			359.010,80
3. MARGIN			
MARGIN CLASS 1 IN EURO			9.815,48
MARGIN IN USD/BETA	93.835,3200	0,87834870	82.420,13
ΣΥΝΟΛΟ II.3			92.235,61
4. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
DBX STX EUROPE BANKS SHORT	8.700,0000	23,92000000	208.104,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			208.104,00
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			6.353.783,01
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			9.295.899,45
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			189.465,41
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			9.485.364,86
III. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FORWARDS IN FOREIGN CURRENCY			
EURO FX USD CURR FUT Jun16	8,0000	1,14120000	1.002.371,54
ΣΥΝΟΛΟ III.1			1.002.371,54
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (III)			1.002.371,54
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			1.002.371,54

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