

SOL GMM BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

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	1.224,9500	0,10907147	133,61
CASH ACCOUNT IN CAD	12.417,0500	0,70101647	8.704,56
CASH ACCOUNT IN AUD	21.790,5900	0,71520526	15.584,74
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			403.509,28
CASH ACCOUNT IN RUB	1.050.117,9000	0,01658017	17.411,14
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			782.255,57
CASH ACCOUNT IN USD	17.029,3200	0,93536620	15.928,65
ΣΥΝΟΛΟ I.1			1.243.527,55
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	3.000,0000	104,66650000	313.999,50
- 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 9.25 19/1/2027	2.000,0000	106,75000000	213.500,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27	Επιτόκιο: 9.25%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			527.499,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			527.499,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			1.771.027,05
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	6.250,0000	71,84451438	449.028,21
- 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:			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	5.700,0000	30,11656805	171.664,44
- Isin: XS1136802615			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-NOV-14 - 19-JUN-18	Επιτόκιο: 10%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BANCO DO BRAZIL, 25/7/2018 3.75%	1.500,0000	102,87500000	154.312,50
- Isin: XS095552178			
- Εκδότης: BANCO DO BRASIL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUL-13 - 25-JUL-18	Επιτόκιο: 3.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	240.000,0000	1,68353423	404.048,22
- 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:			
STATE BANK INDIA 17/4/2019	2.000,0000	95,59348985	191.186,98
- 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:			
SBERBANK OF RUSSIA 28/062019	2.000,0000	98,44729211	196.894,58
- 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	101,49000000	202.980,00
- 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	100,62200000	100.622,00
- 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
- 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	105,00000000	210.000,00
- 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	98,21345057	196.426,90
- Isin: USG3925DAA84			
- Εκδότης: GERDAU TRADE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21	Επιτόκιο: 5.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	100,45832944	150.687,49
- 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:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	3.000,0000	102,71000000	308.130,00
- 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:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	3.000,0000	100,51900000	301.557,00
- 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:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/1/2022	1.500,0000	99,23700000	148.855,50
- Isin: XS1503160225			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-22	Επιτόκιο: 3.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
DEHLI INT AIRPORT 3/2/2022	2.000,0000	100,66878683	201.337,57
- 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:			
OPAP 21/3/2022	1.800,0000	100,66000000	181.188,00
- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22	Επιτόκιο: 3.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GASLOG 8.875 22/3/2022	1.000,0000	94,58890656	94.588,91
- Isin: USG37585AC37			
- Εκδότης: GASLOG LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-MAR-17 - 22-MAR-22	Επιτόκιο: 8.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BRF 3/6/2022	2.000,0000	99,57600000	199.152,00
- 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: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NOVATEK 13/12/2022	2.000,0000	95,17351043	190.347,02
- 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:			
INTER. GAME TECH 15/2/2023	2.000,0000	108,00000000	216.000,00
- Isin: XS1204434028			
- Εκδότης: INTERNATIONAL GAME TECH			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-FEB-15 - 15-FEB-23	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SIGMA ALIMENTOS 7/2/2024	2.000,0000	102,65000000	205.300,00
- Isin: XS1562623584			

- Εκδότης: SIGMA ALIMENTOS SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-FEB-17 - 07-FEB-24	Επιτόκιο: 2.625%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS 4.75% 14/01/2025	2.000,0000	102,87500000	205.750,00
- Isin: XS0982711714			
- Εκδότης: PETROBRAS GLOBAL FINANCE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JAN-14 - 14-JAN-25	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OBRIGACOES DO TESOURO 14/04/2027	2.000,0000	101,26700000	202.534,00
- Isin: PTOTEUOE0019			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOURO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-17 - 14-APR-27	Επιτόκιο: 4.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028	2.000,0000	107,01400000	214.028,00
- 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			5.246.619,32
FLOATING			
GOLDMAN SACHS 15/11/2021	2.000,0000	94,56832850	189.136,66
- Isin: US38145GAF72			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21	Επιτόκιο: 2.209%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.600,0000	100,37788794	160.604,62
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.7696%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			349.741,28
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	2.000,0000	93,50000000	187.000,00
- 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: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			187.000,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			5.783.360,60
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/νία 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	0,19900000	24.156,81
LANXESS AG	1.950,0000	62,89000000	122.635,50
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	8.750,0000	14,70395660	128.659,62
ΜΥΤΙΛΙΝΕΟΣ HOLDINGS S.A.	21.700,0000	7,10000000	154.070,00
UBS GROUP	8.850,0000	14,98691099	132.634,16
ABB LTD-REG	6.100,0000	21,90538519	133.622,85
NATIXIS	23.500,0000	5,77600000	135.736,00
LUKOIL PJSC-SPON ADR	2.600,0000	49,53699373	128.796,18
ΣΥΝΟΛΟ II.3			960.311,12
4. MARGIN			
MARGIN CLASS 1 IN EURO			44.264,25
MARGIN IN USD/BETA	66.332,5200	0,93536620	62.045,20
ΣΥΝΟΛΟ II.4			106.309,45
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	14.550,0000	26,73276588	388.961,74
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	18.450,0000	15,94500000	294.185,25
ΣΥΝΟΛΟ II.5			683.146,99
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			7.870.213,89
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			9.641.240,94
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			-12.410,51
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			9.628.830,43
IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. FUTURES ON CURRENCY			
EUR FX USD FUT JUN17	15,0000	1,07220000	1.880.436,82
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE			Χώρα: UNITED STATES
ΣΥΝΟΛΟ IV.1			1.880.436,82
ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)			1.880.436,82
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)			1.880.436,82

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