



ALPHA ΑΜΟΙΒΑΙΑ ΚΕΦΑΛΑΙΑ

ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ: ALPHA BANK Α.Ε.

**ΕΚΘΕΣΗ ΠΕΡΙΟΔΟΥ ΙΑΝΟΥΑΡΙΟΥ – ΙΟΥΝΙΟΥ 2023**

**ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ**

**ΑΥΓΟΥΣΤΟΣ 2023**

**ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ**  
 Αρ.Εγκρ.ΕΚ 20/Θέμα 9Δ/23.9.1994 ΦΕΚ 776/Β/13.10.1994 ΑΠΟΦ.396/5.11/2021  
 ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ: ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ. (ΑΡ.Γ.Ε.ΜΗ. 920101000)  
 ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ ALPHA BANK Α.Ε.  
 ΕΞΑΜΗΝΙΑΙΑ ΕΚΘΕΣΗ 2023 (Περίοδος 01.01.2023 - 30.06.2023)  
 (Αρ. 77 Ν.4099/12 - Φ.Ε.Κ. 250/Α/ 20.12.2012, Ν.4308/2014)

ΕΙΔΟΣ ΑΞΙΟΓΡΑΦΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ / ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΤΙΜΗ ΜΟΝΑΔΟΣ ΣΕ ΝΟΜΙΣΜΑ ΑΝΑΦΟΡΑΣ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ ΤΟΥ ΣΥΝΟΛΟΥ ΤΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ	ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ ΤΟΥ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ
<b>ΑΝΑΛΥΤΙΚΗ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΗ ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ</b> (Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)					
<b>ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ</b>					
<b>ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ</b>					
<b>ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>					
<b>ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>					
<b>ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ ΕΤΑΙΡΙΚΑ</b>					
PRODEA REAL ESTATE INV -GRC5091217D9	100.000	85,2000	85.200,00	0,17 %	0,17 %
ATTICA ENTERPRICE HOLDIN -GRC1441197B3	200.000	98,5000	197.000,00	0,40 %	0,40 %
TERNA ENERGY FINANCE -GRC813119AD1	50.000	93,1100	<u>46.555,00</u>	0,09 %	0,09 %
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			<b><u>328.755,00</u></b>	<b>0,66 %</b>	<b>0,67 %</b>
<b>ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ Ε.Γ.Ε.Δ.</b>					
HELLENIC T-BILL -GR0000224304	1.300.000	99,6300	<u>1.295.190,00</u>	2,61 %	2,62 %
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ</b>			<b><u>1.295.190,00</u></b>	<b>2,61 %</b>	<b>2,62 %</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>			<b><u>1.623.945,00</u></b>	<b>3,28 %</b>	<b>3,29 %</b>
<b>ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>					
<b>ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ</b>					
<b>ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ TREASURY-BILLS</b>					
FRENCH DISCOUNT T-BILL -FR0127921106	700.000	99,8680	<u>699.076,00</u>	1,41 %	1,42 %
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ</b>			<b><u>699.076,00</u></b>	<b>1,41 %</b>	<b>1,42 %</b>
<b>ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ</b>					
<b>ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ ΕΤΑΙΡΙΚΑ ΣΕ EUR</b>					
MOTOR OIL (HELLAS) SA -XS2364001151	700.000	93,5520	654.864,00	1,32 %	1,33 %
PIRAEUS FINANCIAL HLDGS -XS2018638648	1.000.000	100,4160	1.004.160,00	2,03 %	2,03 %
PROSUS NV -XS2363203089	700.000	68,3550	478.485,00	0,97 %	0,97 %
EUROBANK SA -XS2338193019	2.500.000	87,7780	2.194.450,00	4,43 %	4,45 %
MYTILINEOS FINANCIAL -XS2010038144	500.000	96,8870	484.435,00	0,98 %	0,98 %
GLENCORE CAP FIN DAC -XS2228892860	300.000	86,2950	258.885,00	0,52 %	0,52 %
ENI SPA -XS2344735811	400.000	84,2860	337.144,00	0,68 %	0,68 %
HELLENIC BANK PCL -XS2498640056	500.000	102,0800	510.400,00	1,03 %	1,03 %
ENEL FINANCE INTL NV -XS2531420656	200.000	99,7640	199.528,00	0,40 %	0,40 %
DAIMLER AG 07/2029 1.5% -DE000A2GSCW3	100.000	89,7440	89.744,00	0,18 %	0,18 %
INTESA SANPAOLO SPA -XS2022424993	200.000	85,4920	170.984,00	0,35 %	0,35 %
ALLIANZ SE -DE000A30VTT8	500.000	97,2410	486.205,00	0,98 %	0,98 %
INTESA SANPAOLO SPA -XS2081018629	100.000	89,7630	89.763,00	0,18 %	0,18 %
NATIONAL BANK GREECE SA -XS2028846363	200.000	100,0440	200.088,00	0,40 %	0,41 %
IBM CORP -XS2442764747	300.000	83,6290	250.887,00	0,51 %	0,51 %
BAT INTL FINANCE PLC -XS1203859928	500.000	90,3770	451.885,00	0,91 %	0,92 %
NATIONAL BANK GREECE SA -XS2237982769	1.400.000	93,3370	1.306.718,00	2,64 %	2,65 %
TITAN GLOBAL FINANCE PLC -XS1716212243	1.400.000	96,8670	1.356.138,00	2,74 %	2,75 %
GAZPROM (GAZ CAPITAL SA) -XS0906949523	1.000.000	75,7490	757.490,00	1,53 %	1,53 %
HELLENIC PETROLEUM FINAN -XS2060691719	1.600.000	96,0080	1.536.128,00	3,10 %	3,11 %
ALPHA BANK A.E -XS2307437629	900.000	90,0030	810.027,00	1,64 %	1,64 %
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA -XS2400040460	100.000	91,7980	91.798,00	0,19 %	0,19 %
AT&T INC -XS1144088165	300.000	91,7770	275.331,00	0,56 %	0,56 %
JOHNSON & JOHNSON -XS1412266907	200.000	85,5000	171.000,00	0,35 %	0,35 %
PIRAEUS BANK SA -XS2559486019	800.000	103,3460	826.768,00	1,67 %	1,67 %
VONOVIA SE -DE000A3MQS64	600.000	84,9790	509.874,00	1,03 %	1,03 %
EUROBANK ERG SVCS HLDGS -XS2562543442	400.000	104,2740	417.096,00	0,84 %	0,84 %
ALPHA BANK SA -XS2562213145	3.500.000	102,3190	3.581.165,00	7,23 %	7,25 %
ASTRAZENECA PLC -XS2593105393	500.000	99,6470	498.235,00	1,01 %	1,01 %
MORGAN STANLEY -XS2548080832	500.000	101,0120	505.060,00	1,02 %	1,02 %
JPMORGAN CHASE & CO -XS1615079974	400.000	90,3900	361.560,00	0,73 %	0,73 %
BNP PARIBAS -FE001400AKP6	300.000	92,9460	278.838,00	0,56 %	0,56 %
AUTOSTRAD PER L'ITALIA -XS2434701616	500.000	87,7720	438.860,00	0,89 %	0,89 %
UBS GROUP AG -CH0595205524	500.000	81,6280	408.140,00	0,82 %	0,83 %
MET LIFE GLOB FUNDING I -XS2484586669	100.000	95,2870	<u>95.287,00</u>	0,19 %	0,19 %
			<b>22.087.420,00</b>		

## ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ ΚΡΑΤΙΚΑ ΣΕ EUR

EUROPEAN INVESTMENT BANK -XS2484093393	500.000	88,2130	441.065,00	0,89 %	0,89 %
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -ES0000012K38	1.600.000	93,6440	1.498.304,00	3,02 %	3,03 %
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -ES0000012K20	2.300.000	80,3370	1.847.751,00	3,73 %	3,74 %
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND -DE0001030724	1.500.000	54,0300	810.450,00	1,64 %	1,64 %
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND -DE0001102499	1.000.000	85,3860	853.860,00	1,72 %	1,73 %
REPUBLIC OF AUSTRIA -AT0000A1K9F1	500.000	73,8650	369.325,00	0,75 %	0,75 %
FRANCE (GOVT OF) -FR0000571218	850.000	113,8040	967.334,00	1,95 %	1,96 %
REPUBLIC OF AUSTRIA -AT0000A2HLC4	500.000	41,1480	205.740,00	0,42 %	0,42 %
EUROPEAN UNION -EU000A3KWC4	3.500.000	85,1520	2.980.320,00	6,02 %	6,04 %
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND -DE0001102465	600.000	88,4920	530.952,00	1,07 %	1,08 %
FRANCE (GOVT OF) -FR0011461037	1.400.000	100,3650	1.405.110,00	2,84 %	2,85 %
EUROPEAN INVESTMENT BANK -XS1503043694	1.000.000	84,4090	844.090,00	1,70 %	1,71 %
FRANCE (GOVT OF) -FR0013154044	1.800.000	80,7870	1.454.166,00	2,94 %	2,95 %
KFW -DE000A168Y48	400.000	80,1880	320.752,00	0,65 %	0,65 %
IRISH TSY -IE00BH3SQB22	300.000	70,3840	211.152,00	0,43 %	0,43 %
BELGIUM KINGDOM -BE0000348574	2.300.000	71,1340	1.636.082,00	3,30 %	3,31 %
IRELAND GOVERNMENT BOND -IE00BDHDP444	300.000	91,2650	273.795,00	0,55 %	0,55 %
NETHERLANDS GOVERNMENT -NL0013332430	2.600.000	86,4830	2.248.558,00	4,54 %	4,55 %
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND -DE0001102580	700.000	81,8450	572.915,00	1,16 %	1,16 %
OBRIGACOES DO TESOURO -PTOTETO0012	400.000	99,6880	398.752,00	0,80 %	0,81 %
EUROPEAN UNION -EU000A3KT6A3	3.500.000	79,4090	2.779.315,00	5,61 %	5,63 %
EUROPEAN UNION -EU000A3K4DG1	1.200.000	72,0070	864.084,00	1,74 %	1,75 %
			<b>23.513.872,00</b>	<b>47,47 %</b>	<b>47,64 %</b>
			<b>45.601.292,00</b>	<b>92,06 %</b>	<b>92,38 %</b>

## ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ

## ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

## ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ

## ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ

			<b>47.924.313,00</b>	<b>96,75 %</b>	<b>93,80 %</b>
			<b>47.924.313,00</b>	<b>96,75 %</b>	<b>93,80 %</b>

	Ξ.Ν.	Τιμή Ξ.Ν.	Τρέχουσα αξία σε EUR		
<b>ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ</b>					
ΧΡΕΩΣΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ			47.279,93	0,10 %	0,10 %
ΜΕΤΑΒΑΤΙΚΟΙ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ			324.043,98	0,65 %	0,66 %
ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΠΡΑΞΕΩΝ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ ΣΕ EUR			16.795,25	0,03 %	0,03 %
ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΠΡΑΞΕΩΝ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ ΣΕ USD	121.404,21	0,917262888	111.359,58	0,22 %	0,23 %
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ</b>			<b>499.478,74</b>	<b>1,01 %</b>	<b>1,01 %</b>

## ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ

## ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΦΕΩΣ

ALPHA BANK EUR			1.088.128,97	2,20 %	2,20 %
ALPHA BANK USD	753,84	0,917262888	691,47	0,00 %	0,00 %
CITIBANK EUR			22.934,41	0,05 %	0,05 %
CITIBANK USD	943,57	0,917262888	865,50	0,00 %	0,00 %
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΦΕΩΣ</b>			<b>1.112.620,35</b>	<b>2,25 %</b>	<b>2,25 %</b>
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ</b>			<b>1.112.620,35</b>	<b>2,25 %</b>	<b>2,25 %</b>

## ΣΥΝΟΛΟ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ

## ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ

ΠΙΣΤΩΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ			-85.020,22		-0,17 %
ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ ΑΠΟ ΦΟΡΟΥΣ			-82.998,22		-0,17 %
<b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ</b>			<b>-168.018,44</b>		<b>-0,34 %</b>

## ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ

			<b>49.368.393,65</b>		<b>100,00 %</b>
ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΠΕΡΙΟΔΟΥ 01.01.2023-30.06.2023 Classic			45.434.197,12		
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ ΣΕ ΚΥΚΛΟΦΟΡΙΑ Classic			8.480.808,490		
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ Classic			5,3573		
ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΠΕΡΙΟΔΟΥ 01.01.2023-30.06.2023 Institutional			2.590.223,74		
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ ΣΕ ΚΥΚΛΟΦΟΡΙΑ Institutional			470.564,122		
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ Institutional			5,5045		
ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΠΕΡΙΟΔΟΥ 01.01.2023-30.06.2023 Classic D			1.343.972,79		
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ ΣΕ ΚΥΚΛΟΦΟΡΙΑ Classic D			250.867,757		
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ Classic D			5,3573		

## ΠΡΑΞΕΙΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΪΟΝΤΑ

ΟΝΟΜΑ ΣΥΜΒΟΛΑΙΟΥ	ΕΙΔΟΣ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΤΙΜΗ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ Ξ.Ν.	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ ΣΤΟ ΚΑΘΑΡΟ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟ
US 10YR NOTE (CBT) Sep23 (Πολυαπλασιαστής 1000, ισοτιμία USD: 0,917262887544)	Long	30,000	112,2656	3.367.968,90	3.089.312,88	6,26 %

ΠΙΝΑΚΑΣ ΜΕΤΑΒΟΛΩΝ ΚΙΝΗΤΩΝ ΑΞΙΩΝ ΚΑΙ ΜΕΣΩΝ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ  
ΜΕΤΑΞΥ 30.06.2023 ΚΑΙ 31.12.2022

(Αρ. 77 Ν.4099/12 - Φ.Ε.Κ. 250/Α/ 20.12.2012 & Απ. Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.5)

	30.06.2023	31.12.2022	ΜΕΤΑΒΟΛΗ
<b>ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ</b>	<b>49.368.393,65</b>	<b>50.173.989,18</b>	
<b>ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ</b>	<b>97,09 %</b>	<b>88,90 %</b>	<b>8,19 %</b>
ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ			
ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ	0,67 %	5,85 %	-5,18 %
ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ	4,04 %	0,00 %	4,04 %
ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ	92,38 %	83,05 %	9,33 %

ΑΝΑΛΥΤΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΠΕΡΙΟΔΟΥ 01.01.2023 - 30.06.2023

		ΑΞΙΑ ΣΕ EUR
<b>A. ΠΡΟΣΟΔΟΙ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ</b>		
I. Τόκοι Τραπεζικών Καταθέσεων		1.248,23
II. Έσοδα Ομολογιών αλλοδαπών Δανείων		<u>580.666,96</u>
		<b>581.915,19</b>
<b>B. ΚΕΡΔΗ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ</b>		
I. Κέρδη από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων		19.197,16
II. Ζημιές από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων		<u>-1.245.160,31</u>
		<b>-1.225.963,15</b>
<b>Γ. ΠΡΑΞΕΙΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ</b>		
I. Κέρδη από πράξεις σε Παράγωγα Χρηματοοικονομικά Προϊόντα		543.566,83
II. Ζημιές από πράξεις σε Παράγωγα Χρηματοοικονομικά Προϊόντα		<u>-403.865,56</u>
		<b>139.701,27</b>
<b>Δ. ΕΚΤΑΚΤΑ ΚΑΙ ΑΝΟΡΓΑΝΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ</b>		
I. Συναλλαγματικές Διαφορές		2.144,87
II. Λοιπά έκτακτα και ανόργανα έσοδα		<u>91,68</u>
		<b>2.236,55</b>
<b>Ε. ΕΣΟΔΑ ΚΑΙ ΕΞΟΔΑ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ</b>		
I. Έξοδα προηγούμενων χρήσεων		<u>-46,88</u>
		<b>-46,88</b>
<b>ΣΤ. ΔΑΠΑΝΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ</b>		
I. Αμοιβή Εταιρείας Διαχείρισης		-239.419,60
II. Αμοιβή Θεματοφυλακής		-24.572,92
III. Έξοδα Συμμετοχών και Χρεογράφων		-5.755,20
IV. Φόροι		-86.103,58
V. Τόκοι και Συναφή Έξοδα		-685,20
VI. Έξοδα άρθρου 9 του Κανονισμού		-3.556,18
		<u>-360.092,68</u>
<b>ΖΗΜΙΕΣ ΠΕΡΙΟΔΟΥ 01.01.2023 - 30.06.2023</b>		<b><u>-862.249,70</u></b>

ΠΙΝΑΚΑΣ ΠΗΓΩΝ ΠΡΟΕΛΕΥΣΕΩΣ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΚΑΙ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΑΠΟ 01.01.2023 - 30.06.2023

(Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)

	ΜΕΡΙΔΙΑ	ΑΞΙΑ ΣΕ EUR
<b>I. ΚΕΦΑΛΑΙΑ ΜΕΡΙΔΙΟΥΧΩΝ</b>		
<b>ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Classic</b>		
Μερίδια σε κυκλοφορία την 31.12.2022	8.963.857,014	53.203.499,92
Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.01.2023 - 30.06.2023	438.590,575	2.325.867,33
Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.01.2023 - 30.06.2023	<u>-921.639,099</u>	-4.904.896,86
Ζημιές Περιόδου 01.01.2023 - 30.06.2023		<u>-793.429,45</u>
Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 30.06.2023 ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Classic	<b>8.480.808,490</b>	<b>49.831.040,94</b>
<b>ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Institutional</b>		
Μερίδια σε κυκλοφορία την 31.12.2022	455.457,571	2.770.657,73
Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.01.2023 - 30.06.2023	15.106,551	81.700,00
Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.01.2023 - 30.06.2023	0,000	0,00
Ζημιές Περιόδου 01.01.2023 - 30.06.2023		<u>-45.232,49</u>
Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 30.06.2023 ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Institutional	<b>470.564,122</b>	<b>2.807.125,24</b>
<b>ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Classic D</b>		
Μερίδια σε κυκλοφορία την 31.12.2022	206.931,634	1.228.208,49
Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.01.2023 - 30.06.2023	292.399,912	1.550.231,79
Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.01.2023 - 30.06.2023	<u>-248.463,789</u>	-1.318.743,34
Ζημιές Περιόδου 01.01.2023 - 30.06.2023		<u>-23.587,76</u>
Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 30.06.2023 ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Classic D	<b>250.867,757</b>	<b>1.436.109,18</b>
<b>Συνολική Αξία Καθαρού Ενεργητικού σε αξίες κτήσεως την 30.06.2023</b>		<b>54.074.275,36</b>
<b>II. ΔΙΑΦΟΡΕΣ ΑΠΟΤΙΜΗΣΗΣ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ</b>		
α. Από Κινητές Αξίες / Μέσα Χρηματαγοράς		
Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2023	52.628.048,78	
Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2023	47.924.313,00	
<u>Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας)</u>		-4.703.735,78
β. Από Λοιπά Στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού		
Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2023	1.446.226,58	
Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2023	1.444.080,65	
<u>Σύνολο από λοιπά στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού</u>		<u>-2.145,93</u>
<b>Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας) &amp; Λοιπών Στοιχείων Ενεργητικού / Παθητικού</b>		<b>-4.705.881,71</b>
<b>ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 30.06.2023</b>		<b>49.368.393,65</b>

## ΣΥΓΚΡΙΤΙΚΟΣ ΠΙΝΑΚΑΣ ΤΩΝ ΤΡΙΩΝ ΤΕΛΕΥΤΑΙΩΝ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΙΚΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ

	ΧΡΗΣΗ 2022	ΧΡΗΣΗ 2021	ΧΡΗΣΗ 2020
<b>ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Classic</b>			
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12	46.666.373,58	50.951.128,61	55.675.955,21
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12	8.963.857,014	8.330.396,818	9.011.090,796
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12	5,2061	6,1163	6,1786
<b>ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Institutional</b>			
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12	2.430.226,37	243.810,95	168.966,98
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12	455.457,571	39.094,636	26.955,545
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12	5,3358	6,2364	6,2684
<b>ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ Classic D</b>			
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12	1.077.298,23	0,00	0,00
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12	206.931,634	0,000	0,000
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12	5,2061	0,0000	0,0000

## ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΕΣ ΣΧΕΤΙΚΑ ΜΕ ΤΙΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΣΕ ΟΜΙΛΟΥΣ ΕΤΑΙΡΕΙΩΝ (Αρ.61, παρ.8 Ν.4099/2012)

Τα ποσοστά Επένδυσης του Αμοιβαίου σε Ομίλους Εταιρειών, κατά την 30.06.2023, ήταν εντός του νόμιμου 20% του Καθαρού Ενεργητικού.

Κατά την 30.06.2023 οι επενδύσεις σε κινητές αξίες και μέσα χρηματαγοράς εταιρειών του ίδιου ομίλου αναλύονται ως εξής:

ΟΜΙΛΟΣ/ΕΤΑΙΡΕΙΑ	ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ %
- Eurobank Ergasias SA	<b>2.642.017,82</b>	<b>5,35</b>
- Bonds	2.642.017,82	5,35
- CITIBANK	<b>23.799,91</b>	<b>0,05</b>
- Cash	23.799,91	0,05
- National Bank of Greece SA	<b>1.550.595,04</b>	<b>3,14</b>
- Bonds	1.550.595,04	3,14
- Alpha Services and Holdings SA	<b>5.493.475,56</b>	<b>11,13</b>
- Bonds	4.404.655,12	8,92
- Cash	1.088.820,44	2,21
- BNP PARIBAS	<b>286.545,33</b>	<b>0,58</b>
- Bonds	286.545,33	0,56
- Morgan Stanley	<b>521.476,95</b>	<b>1,06</b>
- Bonds	521.476,95	1,06
- JP MORGAN CHASE & CO	<b>362.347,67</b>	<b>0,73</b>
- Bonds	362.347,67	0,73
- Daimler AG	<b>91.235,78</b>	<b>0,18</b>
- Bonds	91.235,78	0,18
- HELLENIC BANK PCL	<b>553.673,97</b>	<b>1,12</b>
- Bonds	553.673,97	1,12
- EUROPEAN INVESTMENT BANK	<b>1.287.469,17</b>	<b>2,61</b>
- Bonds	1.287.469,17	2,61
- PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA	<b>1.954.452,50</b>	<b>3,96</b>
- Bonds	1.922.726,00	3,89
- HSBC BANK PLC (ΠΑΝΤΕΛΑΚΗΣ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑΚΗ Α.Ε.Π.Ε.Υ.)	<b>128.154,83</b>	<b>0,26</b>
- Cash	128.154,83	0,26
- AURIGA GLOBAL INV. SV	<b>409.621,86</b>	<b>0,83</b>
- Bonds	409.621,86	0,83
- RUSSIAN FEDERATION	<b>757.490,00</b>	<b>1,53</b>
- Bonds	757.490,00	1,53
- HELLENIC REPUBLIC	<b>1.295.190,00</b>	<b>2,62</b>
- Bonds	1.295.190,00	2,62
- Titan Cement Co SA	<b>1.360.294,25</b>	<b>2,76</b>
- Bonds	1.360.294,25	2,76
- JOHNSON & JOHNSON	<b>171.378,69</b>	<b>0,35</b>
- Bonds	171.378,69	0,35
- FRANCE (GOVT OF)	<b>4.541.118,38</b>	<b>9,20</b>
- Bonds	4.541.118,38	9,20
- GEK Terna Holding Real Estate Constructi	<b>46.800,56</b>	<b>0,09</b>
- Bonds	46.800,56	0,09
- GERMANY GOVT	<b>3.094.446,80</b>	<b>6,27</b>
- Bonds	3.094.446,80	6,27
- AUSTRIA REPUBLIC	<b>577.768,39</b>	<b>1,17</b>
- Bonds	577.768,39	1,17
- NETHERLANDS GOVERNMENT	<b>2.254.808,68</b>	<b>4,57</b>
- Bonds	2.257.808,68	4,57
- IRELAND GOVERNMENT BOND	<b>274.141,72</b>	<b>0,56</b>
- Bonds	274.141,72	0,56
- INTESA SAN PAOLO SPA	<b>264.831,93</b>	<b>0,54</b>
- Bonds	264.831,93	0,54

- ASTRAZENCA PLC	504.177,62	1,02
-- Bonds	504.177,62	1,02
- ALLIANZ SE	504.907,86	1,02
-- Bonds	504.907,86	1,02
- IRISH GOVERNMENT	211.729,87	0,43
-- Bonds	211.729,87	0,43
- BELGIUM KINGDOM	1.637.043,48	3,32
-- Bonds	1.637.043,48	3,32
- ENI SPA	337.213,67	0,68
-- Bonds	337.213,67	0,68
- BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	453.763,42	0,92
-- Bonds	453.763,42	0,92
- VOLKSWAGEN INTL FIN NV	259.927,01	0,53
-- Bonds	259.927,01	0,53
- MOTOR OIL FINANCE PLC	661.557,75	1,34
-- Bonds	661.557,75	1,34
- EUROPEAN UNION	6.629.760,10	13,43
-- Bonds	6.629.760,10	13,43
- AT&T INC	279.519,49	0,57
-- Bonds	279.519,49	0,57
- UBS Group AG	408.574,93	0,83
-- Bonds	408.574,93	0,83
- MYTILINEOS FINANCIAL	485.476,67	0,98
-- Bonds	485.476,67	0,98
- ATTICA ENTERPRISE HOLDIN	199.946,67	0,41
-- Bonds	199.946,67	0,41
- IBM CORP	251.908,23	0,51
-- Bonds	251.908,23	0,51
- MET LIFE GLOB FUNDING I	95.463,91	0,19
-- Bonds	95.463,91	0,19
- Kingdom of Spain	3.348.782,32	6,78
-- Bonds	3.348.782,32	6,78
- ENEL SPA	201.941,93	0,41
-- Bonds	201.941,93	0,41
- Hellenic Petroleum SA	1.543.821,99	3,13
-- Bonds	1.543.821,99	3,13
- NASPERS LTD	491.923,18	1,00
-- Bonds	491.923,18	1,00
- Castlelake Opportunities Partn	86.235,00	0,17
-- Bonds	86.235,00	0,17
- VONOVIA SE	509.966,21	1,03
-- Bonds	509.966,21	1,03
- AUTOSTRADE PER L ITALIA	442.354,86	0,90
-- Bonds	442.354,86	0,90

## Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (30.06.2023)

Εκδότης / Χώρα Έκδοσης / Ημ. Έκδοσης	Isin	Ανάκληση (Callability)	Πηγή Τιμολ.	Composite
<b>Ομόλογα Σταθερού Επιτοκίου</b>				
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO / ES / 08/02/2022	ES0000012K38	OXI	BGN	BBB+
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO / ES / 18/01/2022	ES0000012K20	OXI	BGN	BBB+
ASTRAZENECA PLC / GB / 24/02/2023	XS2593105393	OXI	BGN	A-
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 26/06/2019	XS2018638648	OXI	BGN	CCC+
MOTOR OIL FINANCE PLC / GR / 19/07/2021	XS2364001151	OXI	BGN	NR
MET LIFE GLOB FUNDING I / US / 25/05/2022	XS2484586669	OXI	BGN	AA-
EUROPEAN INVESTMENT BANK / 4A / 24/05/2022	XS2484093393	OXI	BGN	AAA
Eurobank Ergasias SA / GR / 05/05/2021	XS2338193019	OXI	BGN	BB-
MYTILINEOS FINANCIAL / LU / 29/11/2019	XS2010038144	OXI	BGN	BB
GLENCORE FINANCE EUROPE / IE / 10/09/2020	XS2228892860	OXI	BGN	BBB+
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND / DE / 15/08/2020	DE0001030724	OXI	BGN	AAA
ENI SPA / IT / 14/06/2021	XS2344735811	OXI	BGN	BBB+
HELLENIC BANK PCL / CY / 15/07/2022	XS2498640056	OXI	BGN	BB-
ENEL FINANCE INTL SA / NL / 09/09/2022	XS2531420656	OXI	BGN	BBB+
Daimler AG / DE / 03/07/2017	DE000A2GSCW3	OXI	BGN	A-
INTESA SAN PAOLO SPA / IT / 04/07/2019	XS2022424993	OXI	BGN	BBB
ALLIANZ SE / DE / 07/09/2022	DE000A30VTT8	OXI	BGN	A
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND / DE / 10/01/2020	DE0001102499	OXI	BGN	AAA
INTESA SAN PAOLO SPA / IT / 19/11/2019	XS2081018629	OXI	BGN	BBB
National Bank of Greece SA / GR / 18/07/2019	XS2028846363	OXI	BGN	B-
IBM CORP / US / 09/02/2022	XS2442764747	OXI	BGN	A-
AUSTRIA REPUBLIC / AT / 23/02/2016	AT0000A1K9F1	OXI	BGN	AA+
FRANCE (GOVT OF) / FR / 25/04/1998	FR00000571218	OXI	BGN	AA
AUSTRIA REPUBLIC / AT / 30/06/2020	AT0000A2HLC4	OXI	BGN	AA+
EUROPEAN UNION / 4A / 21/09/2021	EU000A3KWCF4	OXI	BGN	AA+
BAT INTL FINANCE PLC / GB / 13/03/2015	XS1203859928	OXI	BGN	BBB
PRODEA REAL ESTATE INV / GR / 20/07/2021	GRC5091217D9	OXI	BGN	NR

National Bank of Greece SA / GR / 08/10/2020	XS2237982769	OXI	BGN	BB-
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND / DE / 11/01/2019	DE0001102465	OXI	BGN	AAA
EUROPEAN INVESTMENT BANK / 4C / 12/10/2016	XS1503043694	OXI	BGN	AAA
TITAN GLOBAL FINANCE PLC / GB / 16/11/2017	XS1716212243	OXI	BGN	BB
GAZPROM (GAZ CAPITAL SA) / LU / 21/03/2013	XS0906949523	OXI	BVAL	NR
FRANCE (GOVT OF) / FR / 25/05/2015	FR0013154044	OXI	BGN	AA
KFW / DE / 04/02/2016	DE000A168Y48	OXI	BGN	AAA
HELLENIC PETROLEUM FINAN / GB / 04/10/2019	XS2060691719	OXI	BGN	NR
ATTICA ENTERPRISE HOLDIN / GR / 26/07/2019	GRC1441197B3	OXI	EXCH	NR
IRISH GOVERNMENT / IE / 16/05/2019	IE00BH3SQB22	OXI	BGN	AA-
BELGIUM KINGDOM / BE / 05/02/2019	BE0000348574	OXI	BGN	AA
FRANCE (GOVT OF) / FR / 25/05/2012	FR0011461037	OXI	BGN	AA
OBRIGACOES DO TESOURO / PT / 14/01/2016	PTOTETOE0012	OXI	BGN	BBB
Alpha Services and Holdings SA / GR / 11/03/2021	XS2307437629	OXI	BGN	B-
IRELAND GOVERNMENT BOND / IE / 10/01/2018	IE00BDHDPK44	OXI	BGN	AA-
TERNA ENERGY FINANCE / GR / 22/10/2019	GRC813119AD1	OXI	EXCH	NR
NETHERLANDS GOVERNMENT / NL / 14/02/2019	NL0013332430	OXI	BGN	AAA
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 03/11/2021	XS2400040460	OXI	BGN	B+
AT&T INC / US / 20/11/2014	XS1144088165	OXI	BGN	BBB
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND / DE / 07/01/2022	DE0001102580	OXI	BGN	AAA
PROSUS NV / NL / 13/07/2021	XS2363203089	OXI	BGN	BBB-
JOHNSON & JOHNSON / US / 20/05/2016	XS1412266907	OXI	BGN	AAA
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 02/11/2022	XS2559486019	OXI	BGN	B+
VONOVIA SE / DE / 21/03/2022	DE000A3MQS64	OXI	BGN	BBB+
Eurobank Ergasias SA / GR / 29/11/2022	XS2562543442	OXI	BGN	B
Alpha Services and Holdings SA / GR / 16/12/2022	XS2562213145	OXI	BGN	BB-
JP MORGAN CHASE & CO / US / 11/05/2017	XS1615079974	OXI	BGN	A
EUROPEAN UNION / 4A / 05/04/2022	EU000A3K4DG1	OXI	BGN	AA+
Morgan Stanley / US / 18/10/2023	XS2548080832	OXI	BGN	A
EUROPEAN UNION / 4A / 13/07/2021	EU000A3KT6A3	OXI	BGN	AA+
UBS Group AG / CH / 16/02/2021	CH0595205524	OXI	BGN	A-
BNP PARIBAS / FR / 18/05/2022	FR001400AKP6	OXI	BGN	A-
AUTOSTRADA PER L ITALIA / IT / 18/01/2022	XS2434701616	OXI	BGN	BBB-

**Ομόλογα Zero Coupon**

HELLENIC REPUBLIC / GR / 03/05/2023	GR0000224304	OXI	BOG	BB
FRANCE (GOVT OF) / FR / 17/04/2023	FR0127921106	OXI	BGN	AA

**I. ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗ ΘΕΣΗ (ΙΣΟΛΟΓΙΣΜΟΣ) της 30.06.2023**  
**(N.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.11 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)**

	<b>30.06.2023</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>
Μεταβιβάσιμοι Τίτλοι	47.924.313,00	44.602.589,50	48.398.347,00
Καταθέσεις σε τράπεζες	1.112.620,35	4.984.111,41	2.227.500,75
Λοιπά περιουσιακά στοιχεία	<u>499.478,74</u>	<u>707.367,94</u>	<u>643.653,10</u>
<b>Σύνολο περιουσιακών στοιχείων</b>	<b>49.536.412,09</b>	<b>50.294.068,85</b>	<b>51.269.500,85</b>
Υποχρεώσεις	<u>-168.018,44</u>	<u>-120.170,67</u>	<u>-74.561,29</u>
<b>Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων</b>	<b>49.368.393,65</b>	<b>50.173.898,18</b>	<b>51.194.939,56</b>
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Subfund	<b>9.202.240,369</b>	<b>9.626.246,219</b>	<b>8.369.491,454</b>
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)			-
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Classic	<b>8.480.808,490</b>	<b>8.963.857,014</b>	<b>8.330.396,818</b>
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	<b>5,3573</b>	<b>5,2061</b>	<b>6,1163</b>
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Institutional	<b>470.564,122</b>	<b>455.457,571</b>	<b>39.094,636</b>
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	<b>5,5045</b>	<b>5,3358</b>	<b>6,2364</b>
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Classic D	<b>250.867,757</b>	<b>206.931,634</b>	-
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	<b>5,3573</b>	<b>5,2061</b>	-
<b>Ανάλυση Χαρτοφυλακίου</b>			
1. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε επίσημο χρηματιστήριο αξιών	0,00	0,00	0,00
2. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε άλλες ρυθμιζόμενες αγορές	47.924.313,00	44.602.589,50	48.398.347,00
3. Προσφάτως εκδοθέντες μεταβιβάσιμοι τίτλοι η έκδοση των οποίων περιέχει όρους για εισαγωγή εντός έτους σε επίσημο χρηματιστήριο ή άλλη ρυθμιζόμενη αγορά	0,00	0,00	0,00
4. Λοιποί μεταβιβάσιμοι τίτλοι που δεν περιλαμβάνονται στις περιπτώσεις (1), (2) και (3)	0,00	0,00	0,00
5. Μη Μεταβιβάσιμοι τίτλοι	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>
<b>Σύνολο</b>	<b>47.924.313,00</b>	<b>44.602.589,50</b>	<b>48.398.347,00</b>

**II. ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΞΕΛΙΞΗΣ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΩΝ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ** Περιόδου 01.01.2023 έως 30.06.2023  
 (N.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.12 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

	01.01.-30.06.23	01.01.-30.06.22	01.01.-30.06.21
<b>A. Κατάσταση Αποτελεσμάτων Περιόδου</b>			
Εισόδημα από επενδύσεις	581.915,19	597.777,58	474.985,49
Κέρδη / (Ζημιές) από αγοραπωλησίες κινητών αξιών / μέσω χρηματιστηρίου	-1.086.261,88	-2.965.562,57	364.408,95
Λοιπά εισοδήματα	2.189,67	0,00	0,00
Έξοδα διαχείρισης	-239.419,60	-301.768,99	-277.348,04
Έξοδα θεματοφύλακα	-24.572,92	-30.947,71	-27.784,27
Λοιπά έξοδα και φόροι	-96.100,16	72.092,01	-11.595,24
<b>Καθαρό εισόδημα</b>	<b>-862.249,70</b>	<b>-2.628.409,68</b>	<b>522.666,89</b>
<b>B. Κατάσταση λοιπών μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων αποτελεσμάτων περιόδου</b>			
Έκδοση νέων μεριδίων	3.957.799,12	2.825.738,88	7.363.355,39
Εξαγορές μεριδίων	-6.223.640,20	-11.271.489,43	-8.195.486,98
Ενεργητικό της 21/01/2022 του απορροφώμενου α/κ ALPHA ΕΥΡΩΠΑΪΚΩΝ ΚΡΑΤΙΚΩΝ ΟΜΟΛΟΓΩΝ	0,00	16.611.569,09	0,00
Ενεργητικό της 21/01/2022 του απορροφώμενου α/κ ALPHA GLOBAL ΑΝΑΔΥΟΜΕΝΩΝ ΑΓΟΡΩΝ ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ	0,00	3.426.786,38	0,00
Διαφορές επιμέτρησης επενδύσεων	2.322.586,25	-5.642.060,27	-370.352,07
<b>Σύνολο</b>	<b>56.745,17</b>	<b>5.950.544,65</b>	<b>-1.202.483,66</b>
<b>Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B) περιόδου 01.01-30.06</b>	<b>-805.504,53</b>	<b>3.322.134,97</b>	<b>-679.816,77</b>
<b>Γ. Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων περιόδου 01.07-31.12</b>	<b>0,00</b>	<b>-4.343.176,35</b>	<b>-3.970.165,86</b>
<b>Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B+Γ)</b>	<b>-805.504,53</b>	<b>-1.021.041,38</b>	<b>-4.649.982,63</b>

**ΣΗΜΕΙΩΣΕΙΣ**

- Η σύνταξη της Κατάστασης Χρηματοοικονομικής Θέσης (Ισολογισμός) και η Κατάσταση Εξέλιξης των Καθαρών Περιουσιακών Στοιχείων χρήσεως πραγματοποιήθηκε κατά την κρίση της Διοίκησης της Διαχειρίστριας Εταιρείας, λαμβάνοντας υπόψη τα υποδείγματα του Ν.4308/2014 (Παράρτημα Β) και τις σχετικές αποφάσεις των αρμόδιων αρχών.
- Η αποτίμηση των ομολόγων έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των δημοσιευμένων τιμών κλεισίματος Bloomberg (όπως ορίζεται στην πηγή τιμολόγησης στον Πίνακα Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων) της 30.06.2023. Η τρέχουσα αξία ορίζεται ως το γινόμενο της ονομαστικής αξίας επί τρέχουσα τιμή /100.
- Η αποτίμηση των παραγώγων χρηματοοικονομικών μέσω εξωτερικού που διαπραγματεύονται σε ενεργό αγορά, έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των τιμών κλεισίματος της 30.06.2023. Η αξία τους ανέρχεται σε USD 3.367.968,90 με μετατροπή σε EUR 3.089.312,88 US 10YR NOTE (CBT) Sep23.
- Οι Δεδουλευμένοι Τόκοι των Ομολογιακών Δανείων (μείον οι τόκοι που καταβλήθηκαν για την αγορά τους) περιλαμβάνονται στα έσοδα της περιόδου 01.01.2023 - 30.06.2023 και απεικονίζονται στους μεταβατικούς λογαριασμούς του Ενεργητικού.
- Οι καταθέσεις όψεως που περιλαμβάνονται στην κατηγορία Καταθέσεις σε Πιστωτικά Ιδρύματα αποτιμήθηκαν στην λογιστική τους αξία κατά την 30.06.2023, η οποία δε διαφέρει από την εύλογη αξία τους. Οι δεδουλευμένοι τόκοι των καταθέσεων όψεως έως και την 30.06.2023, περιλαμβάνονται στα έσοδα της περιόδου 01.01.2023 - 30.06.2023.
- Η μετατροπή των ξένων νομισμάτων σε EUR έγινε με βάση το δελτίο συναλλαγματικών ισοτιμιών αναφοράς BGN-BID (ώρα κλεισίματος Χρηματιστηρίου Νέας Υόρκης) της 30.06.2023.
- Ως πιστοληπτική διαβάθμιση των ομολόγων εξωτερικού, λήφθηκε η σύνθεση (composite) των δεικτών των οίκων αξιολόγησης S&P, MOODYS και FITCH, όπως αυτή δημοσιεύεται στη διεθνή αναγνωρισμένη πηγή πληροφόρησης Bloomberg. Όπου δεν υπάρχει σύνθεση δεικτών ως πιστοληπτική διαβάθμιση λήφθηκε κατά σειρά αυτή των οίκων αξιολόγησης S&P, MOODYS και FITCH, με ανάλογη προσαρμογή σε μορφή σύνθεσης (composite) Bloomberg.
- Στον πίνακα προέλευσης καθαρού ενεργητικού και αποτελεσμάτων από 01.01.2023 - 30.06.2023 η αξία των μεριδίων 31.12.2022 εμφανίζεται σε κόστος κτήσεως.
- Τα επί του Καθαρού Ενεργητικού του Αμοιβαίου Κεφαλαίου ποσοστά επενδύσεων σε ομίλους εταιρειών, δεν υπερβαίνουν τα επιτρεπόμενα επενδυτικά όρια σύμφωνα με τις διατάξεις των άρθρων 61 και 65 του Ν.4099/2012.
- Η κατηγοριοποίηση της αξίας των χρηματοοικονομικών στοιχείων του ενεργητικού του αμοιβαίου κεφαλαίου έχει ως εξής:

	Κατηγορία 1	Κατηγορία 2	Κατηγορία 3	Σύνολο
Ομολογίες	47.924.313,00	-	-	47.924.313,00
<b>Σύνολο</b>	<b>47.924.313,00</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>47.924.313,00</b>

- Κατηγορία 1: Στην κατηγορία αυτή περιλαμβάνονται τα χρηματοοικονομικά στοιχεία που επιμετρήθηκαν βάσει δημοσιευμένων τιμών.
- Κατηγορία 2: Στην κατηγορία αυτή περιλαμβάνονται τα χρηματοοικονομικά στοιχεία που επιμετρήθηκαν βάσει τεχνικών επιμέτρησης με χρήση δεδομένων που έχουν παρατηρήσιμες τιμές στην αγορά.
- Κατηγορία 3: Στην κατηγορία αυτή περιλαμβάνονται τα χρηματοοικονομικά στοιχεία που επιμετρήθηκαν βάσει τεχνικών επιμέτρησης με χρήση δεδομένων που δεν έχουν παρατηρήσιμες τιμές στην αγορά.
11. Οι στρατιωτικές επιχειρήσεις στην Ουκρανία που ξεκίνησαν το 2022 παραμένουν αμειωτες. Η έναρξή τους προκάλεσε επιδείνωση της ενεργειακής κρίσης και μεγάλη άνοδο του πληθωρισμού, οδηγώντας σε σημαντικές αυξήσεις επιτοκίων από τις κεντρικές τράπεζες. Το δύσκολο αυτό γεωπολιτικό και οικονομικό περιβάλλον σε διεθνές επίπεδο δημιούργησε συνθήκες αβεβαιότητας και επηρέασε τις παγκόσμιες κεφαλαιαγορές. Ωστόσο, ήδη από τα τέλη του 2022 παρατηρείται αποκλιμάκωση των τιμών ενέργειας και των πληθωριστικών πιέσεων, ενώ η παγκόσμια οικονομία παρουσιάζει ανθεκτικότητα. Η Διαχειρίστρια Εταιρεία παρακολουθεί τις εξελίξεις που σχετίζονται με τις γεωπολιτικές εξελίξεις και τις τυχόν επιπτώσεις που αυτές δύναται να έχουν στις επενδύσεις του Αμοιβαίου Κεφαλαίου, προβαίνοντας στις κατάλληλες ενέργειες όταν αυτό κρίνεται απαραίτητο. Σημειώνεται, ότι το Αμοιβαίο Κεφάλαιο δεν έχει έκθεση σε αξιόγραφα που διαπραγματεύονται στις αγορές των χωρών Ουκρανίας, Ρωσίας και Λευκορωσίας.
12. Το Μάρτιο του 2023, η κατάρρευση ορισμένων περιφερειακών τραπεζών στις Η.Π.Α., μεταξύ αυτών των Silicon Valley Bank, First republic Bank και Signature Bank, προκάλεσε έντονες ανησυχίες για τη σταθερότητα του παγκόσμιου χρηματοπιστωτικού συστήματος. Επιπλέον, η κρίση εμπιστοσύνης προς την ελβετική επενδυτική τράπεζα Credit Suisse οδήγησε στην αναγκαστική εξαγορά της από τη UBS. Και στις δύο περιπτώσεις, η έγκαιρη και αποφασιστική παρέμβαση των ρυθμιστικών αρχών, καθώς και τα ιδιοσυγκρασιακά φύσεως αίτια κατάρρευσης των εν λόγω τραπεζών, βοήθησαν να αποτραπεί μια συστηματικό μέγεθος τραπεζική κρίση. Παρόλο που δεν υπάρχει άμεση έκθεση σε αξιόγραφα των εν λόγω τραπεζών στα χαρτοφυλάκια των Αμοιβαίων Κεφαλαίων, μια εκ νέου και εκτεταμένου μεγέθους κρίση στον τραπεζικό τομέα θα μπορούσε να επηρεάσει αρνητικά τις διεθνείς κεφαλαιαγορές και κατ' επέκταση τις αποδόσεις των χαρτοφυλακίων.

Αθήνα 30.08.2023

Ο Θεματοφύλακας  
ALPHA BANKΗ Εταιρεία Διαχείρισης  
ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

Π.Σ. ΡΑΥΤΟΠΟΥΛΟΣ

Α.Ν. ΑΡΟΤΣΙΔΟΥ

Π.Δ. ΑΝΤΩΝΟΠΟΥΛΟΣ

Π.Δ. ΜΠΛΕΤΣΑ



## Έκθεση Ανεξάρτητου Ορκωτού Ελεγκτή Λογιστή

Προς τη Διοίκηση της “ΑΛΦΑ ASSET MANAGEMENT ΜΟΝΟΠΡΟΣΩΠΗ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΕΩΣ ΑΜΟΙΒΑΙΩΝ ΚΕΦΑΛΑΙΩΝ” για λογαριασμό των μεριδιούχων του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ”

## Έκθεση Ελέγχου επί της Εξαμηνιαίας Έκθεσης Διαχείρισεως του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ”

### Γνώμη

Έχουμε ελέγξει την ανωτέρω Εξαμηνιαία Έκθεση Διαχείρισεως του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA EURO AGGREGATE ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ” (η Έκθεση Διαχείρισεως) της 30<sup>ης</sup> Ιουνίου 2023, που καταρτίστηκε από την διαχειριζόμενη την περιουσία του “ΑΛΦΑ ASSET MANAGEMENT ΜΟΝΟΠΡΟΣΩΠΗ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΕΩΣ ΑΜΟΙΒΑΙΩΝ ΚΕΦΑΛΑΙΩΝ” (η Διαχειρίστρια Εταιρεία) η οποία περιλαμβάνει τον ισολογισμό, την κατάσταση εξέλιξης των καθαρών περιουσιακών στοιχείων περιόδου, καθώς και τις λοιπές πληροφορίες, τα στοιχεία και τις επεξηγηματικές σημειώσεις του Αμοιβαίου Κεφαλαίου. Κατά τη γνώμη μας, η ανωτέρω Έκθεση Διαχείρισεως έχει καταρτιστεί από κάθε ουσιώδη άποψη σύμφωνα με τις σχετικές διατάξεις του Ν. 4308/2014, περιλαμβάνοντας τις πληροφορίες και τα στοιχεία που προβλέπονται από το άρθρο 77 του Ν. 4099/2012 και το άρθρο 4 της απόφασης 17/633/20.12.2012 του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς.

### Βάση γνώμης

Διενεργήσαμε τον έλεγχο μας σύμφωνα με τα Διεθνή Πρότυπα Ελέγχου (ΔΠΕ). Οι ευθύνες μας, σύμφωνα με τα πρότυπα αυτά περιγράφονται περαιτέρω στην ενότητα της έκθεσής μας “Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισεως”. Είμαστε ανεξάρτητοι από την Διαχειρίστρια Εταιρεία, καθόλη τη διάρκεια του διορισμού μας, σύμφωνα με τις απαιτήσεις δεοντολογίας που σχετίζονται με τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισεως στην Ελλάδα και έχουμε εκπληρώσει τις άλλες δεοντολογικές μας υποχρεώσεις σύμφωνα με τις απαιτήσεις αυτές.

Πιστεύουμε ότι τα ελεγκτικά τεκμήρια που έχουμε αποκτήσει είναι επαρκή και κατάλληλα να παρέχουν βάση για τη γνώμη μας.

### Έμφαση θέματος

Εφιστούμε την προσοχή σας στη σημείωση 1 της Έκθεσης Διαχείρισεως όπου γίνεται αναφορά στο πλαίσιο κατάρτισής της σύμφωνα με τις υφιστάμενες κανονιστικές διατάξεις.

Στη γνώμη μας δεν διατυπώνεται επιφύλαξη σε σχέση με το θέμα αυτό.

### Ευθύνες της διοίκησης της Διαχειρίστριας Εταιρείας επί της Έκθεσης Διαχείρισεως

Η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας έχει την ευθύνη για την κατάρτιση της Έκθεσης Διαχείρισεως, σύμφωνα με τις σχετικές διατάξεις του Ν. 4308/2014 και του Ν. 4099/2012 καθώς και της απόφασης 17/633/20.12.2012 του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς και για εκείνες τις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου που η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας καθορίζει ως απαραίτητες, ώστε να καθίσταται δυνατή η κατάρτιση Έκθεσης Διαχείρισεως, απαλλαγμένης από ουσιώδες σφάλμα, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος.

## Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχειρίσεως

Οι στόχοι μας είναι να αποκτήσουμε εύλογη διασφάλιση για το κατά πόσο η Έκθεση Διαχειρίσεως στο σύνολό της είναι απαλλαγμένη από ουσιώδες σφάλμα, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος και να εκδώσουμε έκθεση ελεγκτή, η οποία περιλαμβάνει τη γνώμη μας. Η εύλογη διασφάλιση συνιστά διασφάλιση υψηλού επιπέδου, αλλά δεν είναι εγγύηση ότι ο έλεγχος που διενεργείται σύμφωνα με τα ΔΠΕ θα εντοπίζει πάντα ένα ουσιώδες σφάλμα, όταν αυτό υπάρχει. Σφάλματα δύναται να προκύψουν από απάτη ή από λάθος και θεωρούνται ουσιώδη όταν, μεμονωμένα ή αθροιστικά, θα μπορούσε εύλογα να αναμένεται ότι θα επηρέαζαν τις οικονομικές αποφάσεις των χρηστών, που λαμβάνονται με βάση αυτή την Έκθεση Διαχειρίσεως.

Ως καθήκον του ελέγχου, σύμφωνα με τα ΔΠΕ, ασκούμε επαγγελματική κρίση και διατηρούμε επαγγελματικό σκεπτικισμό καθ' όλη τη διάρκεια του ελέγχου. Επίσης:

- Εντοπίζουμε και αξιολογούμε τους κινδύνους ουσιώδους σφάλματος στις οικονομικές καταστάσεις, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος, σχεδιάζοντας και διενεργώντας ελεγκτικές διαδικασίες που ανταποκρίνονται στους κινδύνους αυτούς και αποκτούμε ελεγκτικά τεκμήρια που είναι επαρκή και κατάλληλα για να παρέχουν βάση για τη γνώμη μας. Ο κίνδυνος μη εντοπισμού ουσιώδους σφάλματος που οφείλεται σε απάτη είναι υψηλότερος από αυτόν που οφείλεται σε λάθος, καθώς η απάτη μπορεί να εμπεριέχει συμπαιγνία, πλαστογραφία, εσκεμμένες παραλείψεις, ψευδείς διαβεβαιώσεις ή παράκαμψη των εσωτερικών δικλίδων ελέγχου.
- Αποκτούμε κατανόηση των δικλίδων εσωτερικού ελέγχου που σχετίζονται με τον έλεγχο, με σκοπό το σχεδιασμό ελεγκτικών διαδικασιών κατάλληλων για τις περιστάσεις, αλλά όχι με σκοπό τη διατύπωση γνώμης επί της αποτελεσματικότητας των δικλίδων εσωτερικού ελέγχου της Διαχειρίστριας Εταιρείας.
- Αξιολογούμε την καταλληλότητα των λογιστικών αρχών και μεθόδων που χρησιμοποιήθηκαν και το εύλογο των λογιστικών εκτιμήσεων και των σχετικών γνωστοποιήσεων που έγιναν από τη διοίκηση.

Αθήνα, 31 Αυγούστου 2023

Ο Ορκωτός Ελεγκτής Λογιστής

**Θεόδωρος Κ. Τασσιούλας**

A.M. ΣΟΕΛ: 41061

Deloitte Ανώνυμη Εταιρία Ορκωτών Ελεγκτών Λογιστών

Φραγκοκκλησιάς 3α & Γρανικού, 151 25 Μαρούσι

A.M. ΣΟΕΛ: Ε 120



This document has been prepared by Deloitte Certified Public Accountants Societe Anonyme.

Deloitte Certified Public Accountants Societe Anonyme, a Greek company, registered in Greece with registered number 0001223601000 and its registered office at Marousi, Attica, 3a Fragkokklisias & Granikou str., 151 25, is one of the Deloitte Central Mediterranean S.r.l. ("DCM") countries. DCM, a company limited by guarantee registered in Italy with registered number 09599600963 and its registered office at Via Tortona no. 25, 20144, Milan, Italy is one of the Deloitte NSE LLP geographies. Deloitte NSE LLP is a UK limited liability partnership and member firm of DTTL, a UK private company limited by guarantee.

DTTL and each of its member firms are legally separate and independent entities. DTTL, Deloitte NSE LLP and Deloitte Central Mediterranean S.r.l. do not provide services to clients. Please see [www.deloitte.com/about](http://www.deloitte.com/about) to learn more about our global network of member firms.