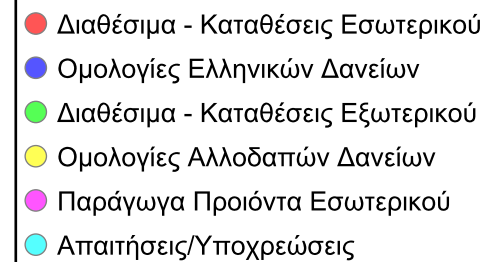
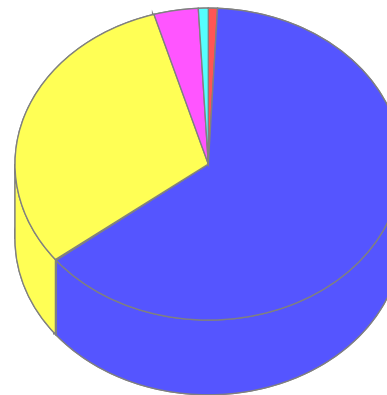




ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ102 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ.Ε.Κ.17/847/7.8.2008

Σύνθεση Ενεργητικού	Αξία	% NAV
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού	135.748,14	0,76
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων	11.345.444,84	63,67
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού	16.432,40	0,09
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων	5.514.293,50	30,94
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού	661.224,44	3,71
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις	146.785,89	0,82
Σύνολα	17.819.929,21	100,00



Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA BANCASSURANCE EE102 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ.Ε.Κ.17/847/7.8.2008

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					135.748,14	0,76
Alpha Services and Holdings SA					135.748,14	0,76
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		135.748,1400	1,00000000	135.748,14	135.748,14	0,76
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					11.345.444,84	63,67
Σταθερού Επιτοκίου					11.345.444,84	63,67
TERNA ENERGY FINANCE	GRC813119AD	344.000,0000	94,30010000	324.392,34	324.392,34	1,82
PRODEA REAL ESTATE INV	GRC5091217D	1.142.000,0000	89,70000000	1.024.374,00	1.024.374,00	5,75
HELLENIC REPUBLIC	GR0124037715	3.800.000,0000	84,85000000	3.224.300,00	3.224.300,00	18,09
HELLENIC REPUBLIC	GR0124034688	100.000,0000	103,17700000	103.177,00	103.177,00	0,58
HELLENIC REPUBLIC	GR0124035693	1.250.000,0000	104,20700000	1.302.587,50	1.302.587,50	7,31
HELLENIC REPUBLIC	GR0118019679	100.000,0000	98,20400000	98.204,00	98.204,00	0,55
HELLENIC REPUBLIC	GR0118020685	100.000,0000	97,96900000	97.969,00	97.969,00	0,55
HELLENIC REPUBLIC	GR0124036709	5.300.000,0000	91,24100000	4.835.773,00	4.835.773,00	27,14
AUTOHELLAS TOURIST AND	GRC3371241B	334.000,0000	100,20000000	334.668,00	334.668,00	1,88
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					16.432,40	0,09
CITIBANK					16.432,40	0,09
Cash CITIBANK (EUR)		16.432,4000	1,00000000	16.432,40	16.432,40	0,09
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					5.514.293,50	30,94
Σταθερού Επιτοκίου					5.514.293,50	30,94
ALPHA BANK SA	XS2761146468	600.000,0000	100,23800000	601.428,00	601.428,00	3,38
ING GROEP NV	XS2764264607	500.000,0000	100,51900000	502.595,00	502.595,00	2,82
EUROBANK SA	XS2724510792	950.000,0000	105,05900000	998.060,50	998.060,50	5,60
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2558592932	500.000,0000	107,96300000	539.815,00	539.815,00	3,03
PIRAEUS BANK SA	XS2728486536	1.500.000,0000	107,12000000	1.606.800,00	1.606.800,00	9,02
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2756298639	500.000,0000	100,06700000	500.335,00	500.335,00	2,81
HELLENIC PETROLEUM FINAN	XS2060691719	300.000,0000	97,75500000	293.265,00	293.265,00	1,65
EUROBANK SA	XS2385386029	500.000,0000	94,39900000	471.995,00	471.995,00	2,65

ALPHA ASSET MANAGEMENT A.E.Δ.Α.Κ. (ΑΡ.Γ.Ε.ΜΗ. 920101000) Πανεπιστημίου 45, 3ος όροφος, ΑΘΗΝΑ 105 64, GR

ΟΙ ΟΣΕΚΑ ΔΕΝ ΕΧΟΥΝ ΕΓΓΥΗΜΕΝΗ ΑΠΟΔΟΣΗ ΚΑΙ ΟΙ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΕΣ ΑΠΟΔΟΣΕΙΣ ΔΕΝ ΔΙΑΣΦΑΛΙΖΟΥΝ ΤΙΣ ΜΕΛΛΟΝΤΙΚΕΣ

Print Date: 10/04/2024 11:50:52

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ102 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ.Ε.Κ.17/847/7.8.2008

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					661.224,44	3,71
SWAP ALPHABANK 3/11/2020-4/11/2030	OTC	19.334.048,0000	0,03420000	661.224,44	661.224,44	3,71
Σύνολο Ενεργητικού					17.673.143,32	99,18
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					146.785,89	0,82
Καθαρό Ενεργητικό					17.819.929,21	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ102 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ.Ε.Κ.17/847/7.8.2008

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (29/03/2024)

Στοιχεία Χρεογράφων					Θέση και Αποτίμηση					Πιστοληπτική Διαβάθμιση
Isin	Εκδότης	Ημ/νία Έναρξης	Ημ/νία Λήξης	Επιτόκιο (%)	Νομ.	Ονομαστική Αξία	Τιμή	Αξία (null)	Πηγή Τιμής	Composite
Ομόλογα Σταθερού Επιτοκίου										
XS2385386029	Eurobank Ergasias SA	14/09/2021	14/03/2028	2,2500	EUR	500.000,00	94,40	471.995,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 03/14/2027@100.00</i>										
XS2724510792	Eurobank Ergasias SA	21/11/2023	28/11/2029	5,8750	EUR	950.000,00	105,06	998.060,50	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 21/11/28 @100</i>										
XS2756298639	National Bank of Greece SA	22/01/2024	29/01/2029	4,5000	EUR	500.000,00	100,07	500.335,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 29/01/2028@100.00</i>										
XS2558592932	National Bank of Greece SA	22/11/2022	22/11/2027	7,2500	EUR	500.000,00	107,96	539.815,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 22/11/26 @100</i>										
XS2761146468	Alpha Services and Holdings SA	05/02/2024	12/05/2030	5,0000	EUR	600.000,00	100,24	601.428,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 12/05/2029@100.00</i>										
XS2728486536	PIRAEUS FINANCIAL	28/11/2023	05/12/2029	6,7500	EUR	1.500.000,00	107,12	1.606.800,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 05/12/2028@100.00</i>										
GR0124034688	HELLENIC REPUBLIC	05/12/2017	30/01/2028	3,7500	EUR	100.000,00	103,18	103.177,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124036709	HELLENIC REPUBLIC	18/06/2020	18/06/2030	1,5000	EUR	5.300.000,00	91,24	4.835.773,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0118020685	HELLENIC REPUBLIC	22/04/2020	22/04/2027	2,0000	EUR	100.000,00	97,97	97.969,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0118019679	HELLENIC REPUBLIC	23/07/2019	23/07/2026	1,8750	EUR	100.000,00	98,20	98.204,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124035693	HELLENIC REPUBLIC	12/03/2019	12/03/2029	3,8750	EUR	1.250.000,00	104,21	1.302.587,50	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124037715	HELLENIC REPUBLIC	05/02/2021	18/06/2031	0,7500	EUR	3.800.000,00	84,85	3.224.300,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
XS2060691719	HELLENIC PETROLEUM FINAN	04/10/2019	04/10/2024	2,0000	EUR	300.000,00	97,76	293.265,00	BGN	NR

ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ. (ΑΡ.Γ.Ε.ΜΗ. 920101000) Πανεπιστημίου 45, 3ος όροφος, ΑΘΗΝΑ 105 64, GR

ΟΙ ΟΣΕΚΑ ΔΕΝ ΕΧΟΥΝ ΕΓΓΥΗΜΕΝΗ ΑΠΟΔΟΣΗ ΚΑΙ ΟΙ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΕΣ ΑΠΟΔΟΣΕΙΣ ΔΕΝ ΔΙΑΣΦΑΛΙΖΟΥΝ ΤΙΣ ΜΕΛΛΟΝΤΙΚΕΣ

Print Date: 10/04/2024 11:50:52

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ102 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ.Ε.Κ.17/847/7.8.2008

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (29/03/2024)

Στοιχεία Χρεογράφων					Θέση και Αποτίμηση					Πιστοληπτική Διαβάθμιση
Isin	Εκδότης	Ημ/νία Έναρξης	Ημ/νία Λήξης	Επιτόκιο (%)	Νομ.	Ονομαστική Αξία	Τιμή	Αξία (null)	Πηγή Τιμής	Composite
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
GRC813119AD1	TERNA ENERGY FINANCE	22/10/2019	22/10/2026	2,6000	EUR	344.000,00	94,30	324.392,34	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
GRC5091217D9	PRODEA REAL ESTATE INV	20/07/2021	20/07/2028	2,3000	EUR	1.142.000,00	89,70	1.024.374,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ GREEN CALL 20/07/2025 @ 102.30</i>										
XS2764264607	ING Groep NV	06/02/2024	12/08/2029	3,8750	EUR	500.000,00	100,52	502.595,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 12/08/28@100</i>										
GRC3371241B9	AUTOHELLAS TOURIST AND	16/01/2024	23/01/2029	4,2500	EUR	334.000,00	100,20	334.668,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 23/07/2027@125.00</i>										