



ALPHA ΑΜΟΙΒΑΙΑ ΚΕΦΑΛΑΙΑ

ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ: ALPHA BANK Α.Ε.

**ΕΚΘΕΣΗ ΠΕΡΙΟΔΟΥ ΙΑΝΟΥΑΡΙΟΥ - ΙΟΥΝΙΟΥ 2025**

**ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ  
ΚΕΦΑΛΑΙΟ**

**ΑΥΓΟΥΣΤΟΣ 2025**

## ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 604 / 14.01.2025

ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ: ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ. (ΑΡ.Γ.Ε.ΜΗ. 920101000)

ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ ALPHA BANK

ΕΞΑΜΗΝΙΑΙΑ ΕΚΘΕΣΗ 24.01.2025 - 30.06.2025

(Αρ. 77 Ν.4099/12 - Φ.Ε.Κ. 250/Α/ 20.12.2012, Ν.4308/2014)

| ΕΙΔΟΣ ΑΞΙΟΓΡΑΦΟΥ                                                                    | ΤΕΜΑΧΙΑ /<br>ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ<br>ΑΞΙΑ | ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΤΙΜΗ<br>ΜΟΝΑΔΟΣ ΣΕ<br>ΝΟΜΙΣΜΑ<br>ΑΝΑΦΟΡΑΣ | ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ<br>ΣΕ Ξ.Ν | ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ<br>ΣΕ EURO    | ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ<br>ΤΟΥ ΣΥΝΟΛΟΥ<br>ΤΟΥ<br>ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ | ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ<br>ΤΟΥ ΣΥΝΟΛΟΥ<br>ΤΟΥ ΚΑΘΑΡΟΥ<br>ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ |
|-------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------|--------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| ΑΝΑΛΥΤΙΚΗ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΗ ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ<br>(Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2) |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ</b>                                                                |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>I. ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>                                                                |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ</b>                                            |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ</b>                                          |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>                                                                   |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| SWAP ALPHA BANK 28/02/2025 - 28/02/2029 (PROSPERITY II)                             | 123.000.000,000                 | -0,0511                                            |                         | <u>-6.284.685,00</u>        | -5,25 %                                          | -5,34 %                                                  |
|                                                                                     |                                 |                                                    |                         | <b>-6.284.685,00</b>        | <b>-5,25 %</b>                                   | <b>-5,34 %</b>                                           |
| <b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ</b>                                |                                 |                                                    |                         | <b><u>-6.284.685,00</u></b> | <b>-5,25 %</b>                                   | <b>-5,34 %</b>                                           |
| <b>ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>                                                 |                                 |                                                    |                         | <b><u>-6.284.685,00</u></b> | <b>-5,25 %</b>                                   | <b>-5,34 %</b>                                           |
| <b>II. ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>                                                               |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ</b>                                               |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ</b>                                                  |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| <b>ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ ΕΤΑΙΡΙΚΑ ΣΕ EUR</b>                                           |                                 |                                                    |                         |                             |                                                  |                                                          |
| PUBLIC POWER CORP / XS2359929812                                                    | 1.700.000                       | 99,2780                                            |                         | 1.687.726,00                | 1,41 %                                           | 1,43 %                                                   |
| BANK POLSKA KASA OPIEKI 09/24/30 / XS2906339747                                     | 4.000.000                       | 101,0890                                           |                         | 4.043.560,00                | 3,38 %                                           | 3,44 %                                                   |
| ALPHA BANK SA / XS2724940619                                                        | 800.000                         | 108,9970                                           |                         | 871.976,00                  | 0,73 %                                           | 0,74 %                                                   |
| PIRAEUS BANK SA / XS2728486536                                                      | 2.600.000                       | 110,7900                                           |                         | 2.880.540,00                | 2,41 %                                           | 2,45 %                                                   |
| TITAN GLOBAL FINANCE PLC / XS2731293168                                             | 200.000                         | 99,4700                                            |                         | 198.940,00                  | 0,17 %                                           | 0,17 %                                                   |
| ALPHA BANK SA / XS2761146468                                                        | 5.969.000                       | 106,2530                                           |                         | 6.342.241,57                | 5,30 %                                           | 5,39 %                                                   |
| COMMERZBANK AG / DE000CZ43ZN8                                                       | 3.000.000                       | 106,7790                                           |                         | 3.203.370,00                | 2,68 %                                           | 2,72 %                                                   |
| PIRAEUS BANK SA / XS2802909478                                                      | 3.500.000                       | 105,7670                                           |                         | 3.701.845,00                | 3,09 %                                           | 3,15 %                                                   |
| HELLENIC ENERGY HOLDINGS / XS2867254224                                             | 2.250.000                       | 102,7860                                           |                         | 2.312.685,00                | 1,93 %                                           | 1,97 %                                                   |
| MEDIOBANCA DI CRED FIN / IT0005586893                                               | 5.000.000                       | 102,6910                                           |                         | 5.134.550,00                | 4,29 %                                           | 4,37 %                                                   |
| PROSUS NV / XS2360853332                                                            | 5.650.000                       | 92,3970                                            |                         | 5.220.430,50                | 4,34 %                                           | 4,44 %                                                   |
| MORGAN STANLEY / XS2790333707                                                       | 800.000                         | 102,8370                                           |                         | 822.696,00                  | 0,69 %                                           | 0,70 %                                                   |
| BANK OF CYPRUS PCL / XS2801451571                                                   | 4.500.000                       | 104,2010                                           |                         | 4.689.045,00                | 3,92 %                                           | 3,99 %                                                   |
| METLEN ENERGY & METALS / XS2920504292                                               | 4.356.000                       | 102,3000                                           |                         | 4.456.188,00                | 3,72 %                                           | 3,79 %                                                   |
| BANCO DE SABADELL SA / XS2782109016                                                 | 3.000.000                       | 104,8880                                           |                         | 3.146.640,00                | 2,63 %                                           | 2,68 %                                                   |
| BARCLAYS PLC / XS2662538425                                                         | 3.200.000                       | 106,5630                                           |                         | 3.410.016,00                | 2,85 %                                           | 2,90 %                                                   |
| KOMMUNALKREDIT AUSTRIA A / AT0000A3BMD1                                             | 4.500.000                       | 105,5720                                           |                         | 4.750.740,00                | 3,97 %                                           | 4,04 %                                                   |
| UBS GROUP AG / CH1414003454                                                         | 2.200.000                       | 99,7000                                            |                         | 2.193.400,00                | 1,83 %                                           | 1,86 %                                                   |
| SOCIETE GENERALE / FR0013410818                                                     | 4.000.000                       | 95,6590                                            |                         | 3.826.360,00                | 3,20 %                                           | 3,25 %                                                   |
| DEUTSCHE BANK AG / DE000A3829D0                                                     | 5.000.000                       | 103,2280                                           |                         | 5.161.400,00                | 4,31 %                                           | 4,39 %                                                   |
| ICCREA BANCA SPA / XS2758880798                                                     | 3.000.000                       | 103,7480                                           |                         | 3.112.440,00                | 2,60 %                                           | 2,65 %                                                   |
| EUROBANK SA / XS2956845262                                                          | 7.815.000                       | 99,5370                                            |                         | 7.778.816,55                | 6,50 %                                           | 6,59 %                                                   |
| NORDDEUTSCHE LANDESBANK / DE000NLB46Y6                                              | 3.000.000                       | 101,9170                                           |                         | 3.057.510,00                | 2,55 %                                           | 2,60 %                                                   |
| BNP PARIBAS / FR0014001JT3                                                          | 4.000.000                       | 91,6870                                            |                         | 3.667.480,00                | 3,06 %                                           | 3,12 %                                                   |
| HSBC HOLDINGS PLC / XS2388491289                                                    | 2.700.000                       | 93,0670                                            |                         | 2.512.809,00                | 2,10 %                                           | 2,14 %                                                   |
| RAIFFEISENBANK AS / XS2831757153                                                    | 2.000.000                       | 103,3990                                           |                         | 2.067.980,00                | 1,73 %                                           | 1,76 %                                                   |
| CTP NV / XS3017990048                                                               | 5.000.000                       | 99,0830                                            |                         | <u>4.954.150,00</u>         | 4,14 %                                           | 4,21 %                                                   |
|                                                                                     |                                 |                                                    |                         | <b>95.205.534,62</b>        | <b>79,53 %</b>                                   | <b>80,94 %</b>                                           |

**ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ ΚΡΑΤΙΚΑ ΣΕ EUR**

|                                         |            |          |                      |         |         |
|-----------------------------------------|------------|----------|----------------------|---------|---------|
| BUONI POLIENNALI DEL TES / IT0005566408 | 8.000.000  | 105,8920 | 8.471.360,00         | 7,08 %  | 7,20 %  |
| STATE OF ISRAEL / XS1936100483          | 20.000.000 | 93,7050  | <u>18.741.000,00</u> | 15,65 % | 15,93 % |

**27.212.360,00 22,73 % 23,13 %**

**ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ 122.417.894,62 102,26 % 104,07 %**

**ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ 122.417.894,62 102,26 % 104,07 %**

**ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ 122.417.894,62 102,26 % 104,07 %**

**ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ 116.133.209,62 97,01 % 98,73 %**

**ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ**

|                                     |  |  |                     |        |        |
|-------------------------------------|--|--|---------------------|--------|--------|
| ΧΡΕΩΣΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ                   |  |  | 1.248.288,24        | 1,04 % | 1,06 % |
| ΜΕΤΑΒΑΤΙΚΟΙ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ |  |  | <u>1.924.925,46</u> | 1,61 % | 1,64 % |

**ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ 3.173.213,70 2,65 % 2,70 %**

**ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ****ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΨΕΩΣ**

|                                   |  |  |                          |               |               |
|-----------------------------------|--|--|--------------------------|---------------|---------------|
| CITIBANK EUR                      |  |  | 12.682,11                | 0,02 %        | 0,01 %        |
| ALPHA ΤΡΑΠΕΖΑ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΙΑ EUR |  |  | <u>388.451,18</u>        | 0,32 %        | 0,33 %        |
| <b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΨΕΩΣ</b> |  |  | <b><u>401.133,29</u></b> | <b>0,34 %</b> | <b>0,34 %</b> |

**ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ 401.133,29 0,34 % 0,34 %**

**ΣΥΝΟΛΟ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 119.707.556,61 100,00 % 101,77 %**

**ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ**

|                                     |  |  |                             |  |                 |
|-------------------------------------|--|--|-----------------------------|--|-----------------|
| ΠΙΣΤΩΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ                   |  |  | -1.912.878,35               |  | -1,63 %         |
| ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ ΑΠΟ ΦΟΡΟΥΣ              |  |  | <u>-166.602,93</u>          |  | -0,14 %         |
| <b>ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ</b> |  |  | <b><u>-2.079.481,28</u></b> |  | <b>101,77 %</b> |

**ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 117.628.075,33 100,00 %**

ΑΞΙΑ ΜΕΡΙΔΙΟΥ (άρθρο 77 Ν.4099/2012 & άρθρο 4 παρ. 3 & 4 απόφαση Ε/Κ 17/633/20.12.2012)

**Αξία EUR**

**ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ**

|                                                           |                |
|-----------------------------------------------------------|----------------|
| Αξία Καθαρού Ενεργητικού Περιόδου 24.01.2025 - 30.06.2025 | 117.628.075,33 |
| Αριθμός Μεριδίων σε κυκλοφορία                            | 12.376.832,364 |
| Τιμή Μεριδίου                                             | 9,5039         |

**ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΤΑΞΕΩΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΙ****ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ ΑΠΟ ΑΜΦΟΤΕΡΟΒΑΡΕΙΣ ΣΥΜΒΑΣΕΙΣ**

|                                                   |                |
|---------------------------------------------------|----------------|
| SWAP ALPHA BANK 28.02.25-02.03.2026 PROSPERITY II | 123.000.000,00 |
| COLLATERAL BUONI POLIENNALI IT0005566408          | -7.200.000,00  |

**ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΤΑΞΕΩΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΙ****ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ ΑΠΟ ΑΜΦΟΤΕΡΟΒΑΡΕΙΣ ΣΥΜΒΑΣΕΙΣ**

|                                                   |                |
|---------------------------------------------------|----------------|
| SWAP ALPHA BANK 28.02.25-02.03.2026 PROSPERITY II | 123.000.000,00 |
| COLLATERAL BUONI POLIENNALI IT0005566408          | -7.200.000,00  |

ΠΙΝΑΚΑΣ ΜΕΤΑΒΟΛΩΝ ΚΙΝΗΤΩΝ ΑΞΙΩΝ ΚΑΙ ΜΕΣΩΝ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ  
ΜΕΤΑΞΥ 30.06.2025 ΚΑΙ 31.12.2024  
(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)

|                                     | 30.06.2025            | 31.12.2024    | ΜΕΤΑΒΟΛΗ       |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------|----------------|
| <b>ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ</b>      | <b>117.628.075,33</b> | <b>0,00</b>   |                |
| <b>ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ</b>                | <b>98,73 %</b>        | <b>0,00 %</b> | <b>98,73 %</b> |
| ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ   |                       |               |                |
| I. ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ                       |                       |               |                |
| ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ | -5,34 %               | 0,00 %        | -5,34 %        |
| ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ      |                       |               |                |
| II. ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ                      |                       |               |                |
| ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ         | 104,07 %              | 0,00 %        | 104,07 %       |

ΑΝΑΛΥΤΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ  
ΠΕΡΙΟΔΟΥ 24.01.2025 - 30.06.2025

|                                                 |                     |                          |
|-------------------------------------------------|---------------------|--------------------------|
| <b>A. ΠΡΟΣΟΔΟΙ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ</b>                |                     | <b>ΑΞΙΑ ΣΕ EUR</b>       |
| I. Τόκοι Τραπεζικών Καταθέσεων                  | 2.954,53            |                          |
| II. Έσοδα Ομολογιών αλλοδαπών Δανείων           | <u>1.332.550,69</u> |                          |
|                                                 |                     | <b>1.335.505,22</b>      |
| <b>B. ΚΕΡΔΗ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ</b>                       |                     |                          |
| I. Κέρδη από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων   | 174.962,67          |                          |
| II. Ζημιές από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων | <u>-130.100,00</u>  |                          |
|                                                 |                     | <b>44.862,67</b>         |
| <b>Γ. ΠΡΑΞΕΙΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ</b>                   |                     |                          |
| I. Έξοδα εξωχρηματιστηριακών παραγώγων          | <u>-529.515,00</u>  |                          |
|                                                 |                     | <b>-529.515,00</b>       |
| <b>Δ. ΕΚΤΑΚΤΑ ΚΑΙ ΑΝΟΡΓΑΝΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ</b>     |                     |                          |
| I. Λοιπά έκτακτα και ανόργανα έσοδα             | <u>431,20</u>       |                          |
|                                                 |                     | <b>431,20</b>            |
| <b>ΣΤ. ΔΑΠΑΝΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ</b>                  |                     |                          |
| I. Αμοιβή Εταιρείας Διαχείρισης                 | -500.663,91         |                          |
| II. Αμοιβή Θεματοφυλακής                        | -45.514,87          |                          |
| III. Έξοδα Συμμετοχών και Χρεογράφων            | -862,50             |                          |
| IV. Φόροι                                       | -166.602,93         |                          |
| V. Τόκοι και Συναφή Έξοδα                       | -566,40             |                          |
| VI. Έξοδα άρθρου 9 του Κανονισμού               | <u>-9.442,17</u>    |                          |
|                                                 |                     | <b>-723.652,78</b>       |
| <b>ΚΕΡΔΗ ΠΕΡΙΟΔΟΥ 24.01.2025 - 30.06.2025</b>   |                     | <b><u>127.631,31</u></b> |

**ΠΙΝΑΚΑΣ ΠΗΓΩΝ ΠΡΟΕΛΕΥΣΕΩΣ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ**  
**ΚΑΙ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΑΠΟ 24.01.2025 - 30.06.2025 (Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)**

| <b>I. ΚΕΦΑΛΑΙΑ ΜΕΡΙΔΙΟΥΧΩΝ</b>                                                                  | <b>ΜΕΡΙΔΙΑ</b>               | <b>ΑΞΙΑ ΣΕ EUR</b>           |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| <b>ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ</b>                                     |                              |                              |
| Μεριδία σε κυκλοφορία την 24.01.2025                                                            | 0,000                        | 0,00                         |
| Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 24.01.2025 - 30.06.2025                                                 | 13.099.131,008               | 130.753.721,09               |
| Μείον Εξαγορές μεριδίων 24.01.2025 - 30.06.2025                                                 | <u>-722.298,644</u>          | -6.940.008,00                |
| Κέρδη Περιόδου 24.01.2025 - 30.06.2025                                                          |                              | <u>127.631,31</u>            |
| Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 30.06.2025 ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ | <b><u>12.376.832,364</u></b> | <b><u>123.941.344,40</u></b> |
| <b>Συνολική Αξία Καθαρού Ενεργητικού σε αξίες κτήσεως την 30.06.2025</b>                        |                              | <b><u>123.941.344,40</u></b> |
| <b>II. ΔΙΑΦΟΡΕΣ ΑΠΟΤΙΜΗΣΗΣ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ</b>                                                    |                              |                              |
| α. Από Κινητές Αξίες / Μέσα Χρηματαγοράς                                                        |                              |                              |
| Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2025                                                                 | 122.446.478,69               |                              |
| Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2025                                                               | <u>116.133.209,62</u>        |                              |
| Σύνολο Υπεραξίας/(Υποαξίας)                                                                     | -6.313.269,07                |                              |
| β. Από Λοιπά Στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού                                                   |                              |                              |
| Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2025                                                                 | 1.494.865,71                 |                              |
| Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2025                                                               | <u>1.494.865,71</u>          |                              |
| Σύνολο από λοιπά στοιχεία Ενεργητικού/Παθητικού                                                 |                              | <u>0,00</u>                  |
| <b>Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας) &amp; Λοιπών Στοιχείων Ενεργητικού / Παθητικού</b>             |                              | <b><u>-6.313.269,07</u></b>  |
| <b>ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 30.06.2025</b>                                             |                              | <b><u>117.628.075,33</u></b> |

**ΣΥΓΚΡΙΤΙΚΟΣ ΠΙΝΑΚΑΣ ΤΩΝ ΤΡΙΩΝ ΤΕΛΕΥΤΑΙΩΝ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΙΚΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ**

|                                                             | <b>ΧΡΗΣΗ 2024</b> | <b>ΧΡΗΣΗ 2023</b> | <b>ΧΡΗΣΗ 2022</b> |
|-------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ</b> |                   |                   |                   |
| <b>ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12</b>                        | 0,00              | 0,00              | 0,00              |
| <b>ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12</b>                               | 0,000             | 0,000             | 0,000             |
| <b>ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12</b>                                  | 0,0000            | 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 30.06.2025, ήταν εντός του νόμιμου 20% του Καθαρού Ενεργητικού.

Κατά την 30.06.2025 οι επενδύσεις σε κινητές αξίες και μέσα χρηματαγοράς εταιρειών του ίδιου ομίλου αναλύονται ως εξής:

| <b>ΟΜΙΛΟΣ/ΕΤΑΙΡΕΙΑ</b>                | <b>ΑΞΙΑ ΣΕ EURO</b> | <b>ΠΟΣΟΣΤΟ</b> |
|---------------------------------------|---------------------|----------------|
| <b>CITIBANK</b>                       | <b>12.682,11</b>    | <b>0,01 %</b>  |
| - Χρηματικά Διαθέσιμα                 | 12.682,11           | 0,01 %         |
| <b>ALPHA ΤΡΑΠΕΖΑ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΙΑ</b>  | <b>1.390.352,24</b> | <b>1,18 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 7.286.586,06        | 6,19 %         |
| - Παράγωγα Χρηματοοικονομικά Προϊόντα | -6.284.685,00       | -5,34 %        |
| - Χρηματικά Διαθέσιμα                 | 388.451,18          | 0,33 %         |
| <b>BNP PARIBAS</b>                    | <b>3.676.411,51</b> | <b>3,13 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 3.676.411,51        | 3,13 %         |
| <b>Morgan Stanley</b>                 | <b>831.148,23</b>   | <b>0,71 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 831.148,23          | 0,71 %         |
| <b>PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA</b>  | <b>6.718.834,32</b> | <b>5,71 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 6.718.834,32        | 5,71 %         |
| <b>Titan Cement Co SA</b>             | <b>199.358,03</b>   | <b>0,17 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 199.358,03          | 0,17 %         |
| <b>METLEN ENERGY &amp; METALS</b>     | <b>4.578.872,05</b> | <b>3,89 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 4.578.872,05        | 3,89 %         |
| <b>Public Power Corp SA</b>           | <b>1.711.810,38</b> | <b>1,46 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 1.711.810,38        | 1,46 %         |
| <b>DEUTSCHE BANK</b>                  | <b>5.211.126,03</b> | <b>4,43 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 5.211.126,03        | 4,43 %         |
| <b>HSBC Holdings PLC</b>              | <b>2.526.085,60</b> | <b>2,15 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 2.526.085,60        | 2,15 %         |
| <b>UBS Group AG</b>                   | <b>2.217.486,99</b> | <b>1,89 %</b>  |
| - Ομολογίες                           | 2.217.486,99        | 1,89 %         |

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

|                                 |                      |                |
|---------------------------------|----------------------|----------------|
| <b>Societe Generale SA</b>      | <b>3.845.729,86</b>  | <b>3,27 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 3.845.729,86         | 3,27 %         |
| <b>Republic of Italy</b>        | <b>8.607.271,60</b>  | <b>7,32 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 8.607.271,60         | 7,32 %         |
| <b>Hellenic Petroleum SA</b>    | <b>2.354.421,88</b>  | <b>2,00 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 2.354.421,88         | 2,00 %         |
| <b>NASPERS LTD</b>              | <b>5.290.810,00</b>  | <b>4,50 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 5.290.810,00         | 4,50 %         |
| <b>EUROBANK HOLDINGS</b>        | <b>7.856.056,58</b>  | <b>6,68 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 7.856.056,58         | 6,68 %         |
| <b>BANK OF CYPRUS PCL</b>       | <b>4.726.031,30</b>  | <b>4,02 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 4.726.031,30         | 4,02 %         |
| <b>COMMERZBANK AG</b>           | <b>3.272.452,19</b>  | <b>2,78 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 3.272.452,19         | 2,78 %         |
| <b>RAIFFEISEN BANK INTL</b>     | <b>2.075.044,88</b>  | <b>1,76 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 2.075.044,88         | 1,76 %         |
| <b>BARCLAYS PLC</b>             | <b>3.551.007,65</b>  | <b>3,02 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 3.551.007,65         | 3,02 %         |
| <b>MEDIOBANCA DI CRED FIN</b>   | <b>5.383.505,48</b>  | <b>4,58 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 5.383.505,48         | 4,58 %         |
| <b>BANCO DE SABADELL SA</b>     | <b>3.248.290,68</b>  | <b>2,76 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 3.248.290,68         | 2,76 %         |
| <b>KOMMUNALKREDIT AUSTRIA A</b> | <b>4.812.229,73</b>  | <b>4,09 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 4.812.229,73         | 4,09 %         |
| <b>STATE OF ISRAEL</b>          | <b>18.877.438,36</b> | <b>16,05 %</b> |
| - Ομολογίες                     | 18.877.438,36        | 16,05 %        |
| <b>NORDDEUTSCHE LANDESBANK</b>  | <b>3.144.807,95</b>  | <b>2,67 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 3.144.807,95         | 2,67 %         |
| <b>ICCREA BANCA SPA</b>         | <b>3.163.440,00</b>  | <b>2,69 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 3.163.440,00         | 2,69 %         |
| <b>CTP NV</b>                   | <b>5.010.263,01</b>  | <b>4,26 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 5.010.263,01         | 4,26 %         |
| <b>BANK POLSKA KASA OPIEKI</b>  | <b>4.166.299,73</b>  | <b>3,54 %</b>  |
| - Ομολογίες                     | 4.166.299,73         | 3,54 %         |

| Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (30.06.2025) |              |                        |             |           |
|----------------------------------------------------|--------------|------------------------|-------------|-----------|
| Εκδότης / Χώρα Έκδοσης / Ημ. Έκδοσης               | Isin         | Ανάκληση (Callability) | Πηγή Τιμολ. | Composite |
| <b>Ομόλογα Σταθερού Επιτοκίου</b>                  |              |                        |             |           |
| BUONI POLIENNALI DEL TES / IT / 28.09.2023         | IT0005566408 | OXI                    | BGN         | BBB       |
| CTP NV / NL / 03.03.2025                           | XS3017990048 | OXI                    | CBBT        | BBB-      |
| HELLENIQ ENERGY Holdings S.A / GR / 17.07.2024     | XS2867254224 | OXI                    | CBBT        | NR        |
| NORDDEUTSCHE LANDESBANK / DE / 03.09.2024          | DE000NLB46Y6 | OXI                    | CBBT        | A+        |
| METLEN ENERGY & METALS / GR / 09.10.2024           | XS2920504292 | OXI                    | CBBT        | BB+       |
| KOMMUNALKREDIT AUSTRIA A / AT / 21.03.2024         | AT0000A3BMD1 | OXI                    | CBBT        | BBB       |
| TITAN GLOBAL FINANCE PLC / GB / 07.12.2023         | XS2731293168 | OXI                    | BVAL        | BB+       |
| Societe Generale SA / FR / 22.03.2020              | FR0013410818 | OXI                    | CBBT        | BBB       |
| STATE OF ISRAEL / IL / 16.01.2020                  | XS1936100483 | OXI                    | CBBT        | A-        |
| PROSUS NV / NL / 07.07.2021                        | XS2360853332 | OXI                    | CBBT        | BBB       |
| Public Power Corp SA / GR / 21.07.2021             | XS2359929812 | OXI                    | BGN         | BB-       |
| <b>Ομόλογα Κυμαινόμενου Επιτοκίου</b>              |              |                        |             |           |
| UBS Group AG / CH / 06.02.2025                     | CH1414003454 | OXI                    | CBBT        | A-        |
| DEUTSCHE BANK / DE / 26.03.2024                    | DE000A3829D0 | OXI                    | CBBT        | BBB+      |
| ICCREA BANCA SPA / IT / 29.01.2024                 | XS2758880798 | OXI                    | CBBT        | BBB-      |
| EUROBANK ERGASIAS S.A. / GR / 05.12.2024           | XS2956845262 | OXI                    | CBBT        | BBB       |
| BNP PARIBAS / FR / 12.01.2021                      | FR0014001JT3 | OXI                    | CBBT        | A-        |
| RAIFFEISEN BANK INTL / CZ / 29.05.2024             | XS2831757153 | OXI                    | CBBT        | BBB       |
| BARCLAYS PLC / GB / 01.08.2023                     | XS2662538425 | OXI                    | CBBT        | BBB+      |
| BANCO DE SABADELL SA / ES / 13.03.2024             | XS2782109016 | OXI                    | CBBT        | BBB       |
| BANK OF CYPRUS PCL / CY / 24.04.2024               | XS2801451571 | OXI                    | BGN         | BBB-      |
| Morgan Stanley / US / 18.03.2024                   | XS2790333707 | OXI                    | CBBT        | A         |
| MEDIOBANCA DI CRED FIN / IT / 12.03.2024           | IT0005586893 | OXI                    | BGN         | BBB-      |
| PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 09.04.2024    | XS2802909478 | OXI                    | BGN         | BBB-      |
| COMMERZBANK AG / DE / 11.01.2023                   | DE000CZ43ZN8 | OXI                    | BGN         | BBB       |
| ALPHA ΤΡΑΠΕΖΑ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΙΑ / GR / 05.02.2024    | XS2761146468 | OXI                    | BGN         | BBB       |
| PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 28.11.2023    | XS2728486536 | OXI                    | BGN         | BBB-      |
| ALPHA ΤΡΑΠΕΖΑ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΙΑ / GR / 17.11.2023    | XS2724940619 | OXI                    | bval        | BBB       |
| BANK POLSKA KASA OPIEKI / PL / 17.09.2024          | XS2906339747 | OXI                    | CBBT        | BBB       |
| HSBC Holdings PLC / GB / 17.09.2021                | XS2388491289 | OXI                    | BGN         | A-        |

Πηγές Τιμών: Bloomberg Composite Bond Trading (CBBT)

I. ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗ ΘΕΣΗ (ΙΣΟΛΟΓΙΣΜΟΣ) της 30.06.2025  
(Ν.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.11 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

|                                                           | <u>30.06.2025</u>            | <u>31.12.2024</u>  | <u>31.12.2023</u>  |
|-----------------------------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
| Μεταβιβάσιμοι Τίτλοι                                      | 122.417.894,62               | 0,00               | 0,00               |
| Μη Μεταβιβάσιμοι Τίτλοι                                   | -6.284.685,00                | 0,00               | 0,00               |
| Καταθέσεις σε τράπεζες                                    | 401.133,29                   | 0,00               | 0,00               |
| Λοιπά περιουσιακά στοιχεία                                | <u>3.173.213,70</u>          | <u>0,00</u>        | <u>0,00</u>        |
| <b>Σύνολο περιουσιακών στοιχείων</b>                      | <b>119.707.556,61</b>        | <b>0,00</b>        | <b>0,00</b>        |
| Υποχρεώσεις                                               | <u>-2.079.481,28</u>         | <u>0,00</u>        | <u>0,00</u>        |
| <b>Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων</b>                | <b><u>117.628.075,33</u></b> | <b><u>0,00</u></b> | <b><u>0,00</u></b> |
|                                                           |                              |                    |                    |
| Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Subfund          | <b>12.376.832,364</b>        | <b>0,000</b>       | <b>0,000</b>       |
| Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια) | <b>9,5039</b>                | <b>0,0000</b>      | <b>0,0000</b>      |

**Ανάλυση Χαρτοφυλακίου**

|                                                                                                                                                            |                              |                    |                    |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
| 1. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε επίσημο χρηματιστήριο αξιών                                                                               | 0,00                         | 0,00               | 0,00               |
| 2. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε άλλες ρυθμιζόμενες αγορές                                                                                 | 122.417.894,62               | 0,00               | 0,00               |
| 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>-6.284.685,00</u>         | <u>0,00</u>        | <u>0,00</u>        |
| <b>Σύνολο</b>                                                                                                                                              | <b><u>116.133.209,62</u></b> | <b><u>0,00</u></b> | <b><u>0,00</u></b> |

II. ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΞΕΛΙΞΗΣ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΩΝ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ Περιόδου 24.01.2025 έως 30.06.2025

(Ν.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.12 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

|                                                                                            | <u>24.01.-30.06.25</u>       | <u>01.01.-30.06.24</u> | <u>01.01.-30.06.23</u> |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|------------------------|------------------------|
| <b>A. Κατάσταση Αποτελεσμάτων Περιόδου</b>                                                 |                              |                        |                        |
| Εισόδημα από επενδύσεις                                                                    | 1.335.505,22                 | 0,00                   | 0,00                   |
| Κέρδη / (Ζημιές) από αγοραπωλησίες κινητών αξιών / μέσων χρηματαγοράς                      | -484.652,33                  | 0,00                   | 0,00                   |
| Λοιπά εισοδήματα                                                                           | 431,20                       | 0,00                   | 0,00                   |
| Έξοδα διαχείρισης                                                                          | -500.663,91                  | 0,00                   | 0,00                   |
| Έξοδα θεματοφύλακα                                                                         | -45.514,87                   | 0,00                   | 0,00                   |
| Λοιπά έξοδα και φόροι                                                                      | <u>-177.474,00</u>           | <u>0,00</u>            | <u>0,00</u>            |
| <b>Καθαρό εισόδημα</b>                                                                     | <b><u>127.631,31</u></b>     | <b><u>0,00</u></b>     | <b><u>0,00</u></b>     |
|                                                                                            |                              |                        |                        |
| <b>B. Κατάσταση λοιπών μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων αποτελεσμάτων περιόδου</b> |                              |                        |                        |
| Έκδοση νέων μεριδίων                                                                       | 130.753.721,09               | 0,00                   | 0,00                   |
| Εξαγορές μεριδίων                                                                          | -6.940.008,00                | 0,00                   | 0,00                   |
| Διαφορές επιμέτρησης επενδύσεων                                                            | <u>-6.313.269,07</u>         | <u>0,00</u>            | <u>0,00</u>            |
| <b>Σύνολο</b>                                                                              | <b><u>117.500.444,02</u></b> | <b><u>0,00</u></b>     | <b><u>0,00</u></b>     |
|                                                                                            |                              |                        |                        |
| <b>Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B) περιόδου 24.01-30.06</b>          | <b><u>117.628.075,33</u></b> | <b><u>0,00</u></b>     | <b><u>0,00</u></b>     |
|                                                                                            |                              |                        |                        |
| <b>Γ. Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων περιόδου 01.07-31.12</b>             | <b><u>0,00</u></b>           | <b><u>0,00</u></b>     | <b><u>0,00</u></b>     |
|                                                                                            |                              |                        |                        |
| <b>Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B+Γ)</b>                             | <b><u>117.628.075,33</u></b> | <b><u>0,00</u></b>     | <b><u>0,00</u></b>     |

## ΣΗΜΕΙΩΣΕΙΣ

1. Η σύνταξη της Κατάστασης Χρηματοοικονομικής Θέσης (Ισολογισμός) και η Κατάσταση Εξέλιξης των Καθαρίων Περιουσιακών Στοιχείων περιόδου, 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.□
2. Η αποτίμηση των ομολόγων εξωτερικού έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των δημοσιευμένων τιμών κλεισίματος Bloomberg (όπως ορίζεται στην πηγή τιμολόγησης στον Πίνακα Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων) της 30.06.2025. Η τρέχουσα αξία ορίζεται ως το γινόμενο της ονομαστικής αξίας επί τρέχουσα τιμή /100.□
3. Το Α/Κ έχει συνάψει σύμβαση SWAP με αντισυμβαλλόμενο την ALPHA BANK στον δείκτη Solactive Global Mid Cap Index NTR Decrement 5% in EUR (Bloomberg Ticker: SOGMC5 INDEX) από 28.02.2025 (Quantity 76,027.29565 \* Initial Index Level 1,617.84, EUR Amount 123.000.000,00) έως 28.02.2029.
- Σε θετική απόδοση του δείκτη SOGMC5 INDEX, θα λάβουμε απόδοση στο Swap το 120 % της απόδοσης αυτής, για την ονομαστική αξία που έχει συμφωνηθεί (EUR 123.000.000,00) με όριο απόδοσης 30% (έως +30%).
- Σε αρνητική απόδοση του δείκτη SOGMC5 INDEX, η απόδοση του προϊόντος θα είναι αρνητική με όριο 10 % (έως -10%).

| Κανονισμός (ΕΕ) 2015/2365 Της 25.11.2015 - Τμήμα Α — Πληροφορίες που πρέπει να παρέχονται στις εξαμηνιαίες εκθέσεις των ΟΣΕΚΑ.                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                         |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Συνολικά δεδομένα:</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                         |
| — το ποσό των τίτλων και εμπορευμάτων που αφορά ο δανεισμός ως ποσοστό των συνολικών δανείσιμων περιουσιακών στοιχείων οριζόμενων εκτός των ταμειακών διαθεσίμων και των ταμειακών ισοδυνάμων.                                                                                                                                                                                                    | -                                                                                                                                                       |
| — το ποσό των περιουσιακών στοιχείων που περιλαμβάνει κάθε τύπος ΣΧΤ και συμφωνίας ανταλλαγής συνολικής απόδοσης, εκφραζόμενο ως απόλυτο ποσό (στο νόμισμα του οργανισμού συλλογικών επενδύσεων) και ως ποσοστό των υπό διαχείριση περιουσιακών στοιχείων του οργανισμού αυτού (ΥΔΠΣ).                                                                                                            | Τρέχουσα Αξία 116.185.800,00 Ευρώ<br>ήτοι ποσοστό 98,77% επί του συνόλου του ενεργητικού                                                                |
| <b>Δεδομένα συγκέντρωσης:</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                         |
| — οι δέκα σημαντικότεροι εκδότες ασφαλείων σε όλες τις ΣΧΤ και τις συμφωνίες ανταλλαγής συνολικής απόδοσης (κατανομή όγκων των εμπράγματων ασφαλείων και βασικών εμπορευμάτων που λαμβάνονται ανά εκδότη).                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                         |
| — οι δέκα σημαντικότεροι αντισυμβαλλόμενοι για κάθε τύπο ΣΧΤ και συμφωνίας ανταλλαγής συνολικής απόδοσης χωριστά (όνομα του αντισυμβαλλομένου και συνολικός όγκος των εκκρεμών συναλλαγών).                                                                                                                                                                                                       | Alpha Bank (Συμφωνία Ανταλλαγής συνολικής απόδοσης ονομαστικής αξίας 123.000.000,00 Ευρώ)                                                               |
| <b>Συγκεντρωτικά δεδομένα σχετικά με τις συναλλαγές για κάθε τύπο ΣΧΤ και συμφωνίας ανταλλαγής συνολικής απόδοσης χωριστά —κατανεμημένα βάσει των ακόλουθων κατηγοριών:</b>                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                         |
| — τύπος και ποιότητα της ασφάλειας.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                         |
| — διάρκεια ληκτότητας της ασφάλειας βάσει των ακόλουθων κλιμακίων διάρκειας: λιγότερο από μία ημέρα, μία ημέρα έως μία εβδομάδα, μία εβδομάδα έως ένας μήνας, ένας μήνας έως τρεις μήνες, τρεις μήνες έως ένα έτος, άνω του ενός έτους, ανοικτή ληκτότητα.                                                                                                                                        |                                                                                                                                                         |
| — νόμισμα της ασφάλειας.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                         |
| — διάρκεια ληκτότητας της ΣΧΤ και των συμφωνιών ανταλλαγής συνολικής απόδοσης βάσει των ακόλουθων κλιμακίων διάρκειας: λιγότερο από μία ημέρα, μία ημέρα έως μία εβδομάδα, μία εβδομάδα έως ένας μήνας, ένας μήνας έως τρεις μήνες, τρεις μήνες έως ένα έτος, άνω του ενός έτους, ανοικτές συναλλαγές.                                                                                            |                                                                                                                                                         |
| — χώρα στην οποία είναι εγκατεστημένοι οι αντισυμβαλλόμενοι.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                         |
| — διακανονισμός και συμψηφισμός (π.χ. τριμερής, κεντρικός αντισυμβαλλόμενος, διμερής).                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                         |
| <b>Δεδομένα σχετικά με την επαναχρησιμοποίηση της ασφάλειας:</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                         |
| — ποσοστό της εισπραχθείσας ασφάλειας το οποίο επαναχρησιμοποιείται, σε σύγκριση με το ανώτατο ποσό που καθορίζεται στο ενημερωτικό δελτίο ή στην πληροφόρηση των επενδυτών.                                                                                                                                                                                                                      | -                                                                                                                                                       |
| — απόδοση της επανεπένδυσης της ασφάλειας σε μετρητά για τον οργανισμό συλλογικών επενδύσεων.                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | -                                                                                                                                                       |
| <b>Διακράτηση της ασφάλειας που εισπράττει ο οργανισμός συλλογικών επενδύσεων ως μέρος της ΣΧΤ και των συμφωνιών ανταλλαγής συνολικής απόδοσης:</b>                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                         |
| Αριθμός και ονόματα των θεματοφυλάκων και ποσό των περιουσιακών στοιχείων που προσκομίζονται ως ασφάλειες και τα οποία διακρατεί κάθε θεματοφύλακας.                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                         |
| <b>Διακράτηση της ασφάλειας που παρέχει ο οργανισμός συλλογικών επενδύσεων ως μέρος της ΣΧΤ και των συμφωνιών ανταλλαγής συνολικής απόδοσης:</b>                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                         |
| Το ποσοστό των ασφαλείων που τηρούνται είτε σε διαχωρισμένους είτε σε ομαδοποιημένους λογαριασμούς ή σε οποιοσδήποτε άλλους λογαριασμούς.                                                                                                                                                                                                                                                         | BUONI ORDINARI DEL TES (IT0005566408) - Ονομαστικής Αξίας 7.200.000 Ευρώ και Τρέχουσας Αξίας 7.746.544,44 Ευρώ, ήτοι ποσοστό 6,59% επί του ενεργητικού. |
| Δεδομένα σχετικά με την απόδοση και το κόστος για κάθε τύπο ΣΧΤ και συμφωνιών ανταλλαγής συνολικής απόδοσης, κατανεμημένα μεταξύ οργανισμού συλλογικών επενδύσεων, διαχειριστή τέτοιου οργανισμού και τρίτων (π.χ. φορέα δανεισμού) σε απόλυτους αριθμούς και ως ποσοστό επί του συνόλου των αποδόσεων που προέρχονται από τον συγκεκριμένο τύπο ΣΧΤ και συμφωνιών ανταλλαγής συνολικής απόδοσης. | Απόδοση: -6.284.685,00 Ευρώ, αντισυμβαλλόμενος Alpha Bank (Συμφωνία Ανταλλαγής Συνολικής Απόδοσης 100%)<br>Κόστος: 529.515,00                           |

4. Οι δεδουλευμένοι τόκοι των ομολογιακών δανείων (μείον οι τόκοι που καταβλήθηκαν για την αγορά τους) περιλαμβάνονται στα έσοδα της περιόδου 01.01.2025 - 30.06.2025 και απεικονίζονται στους μεταβατικούς λογαριασμούς του Ενεργητικού.
5. Οι καταθέσεις όψεως που περιλαμβάνονται στην κατηγορία Καταθέσεις σε Πιστωτικά Ιδρύματα αποτιμήθηκαν στην λογιστική τους αξία κατά την 30.06.2025, η οποία δε διαφέρει από την εύλογη αξία τους. Οι δεδουλευμένοι τόκοι των καταθέσεων όψεως έως και την 30.06.2025, περιλαμβάνονται στα έσοδα της περιόδου 24.01.2025 - 30.06.2025.
6. 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.
7. 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 έως 65 του Ν.4099/2012.
8. Με την υπ' αριθμ. 604 / 14.01.2025 απόφαση της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς χορηγήθηκε άδεια σύστασης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ, το οποίο σύμφωνα με απόφαση της διοίκησης, ξεκίνησε τη δραστηριότητα του την 24.01.2025. Επενδυτικός σκοπός του Αμοιβαίου Κεφαλαίου είναι, να προσφέρει στο μεριδιούχο που συμμετείχε έως την 28.02.2025 και θα διακρατήσει την επένδυσή του μέχρι την 28.02.2029, διατήρηση του κεφαλαίου, επιδιώκοντας ταυτόχρονα τη δημιουργία εισοδήματος και κεφαλαιακής υπεραξίας. Για την επίτευξη του σκοπού του, το Αμοιβαίο Κεφάλαιο, επενδύει σε ομόλογα ή/και εξωχρηματοπιστηριακά παράγωγα με ομολογιακή έκθεση, μέσα χρηματαγοράς και λοιπά αξιόγραφα.
9. Η κατηγοριοποίηση της αξίας των χρηματοοικονομικών στοιχείων του ενεργητικού του αμοιβαίου κεφαλαίου έχει ως εξής:

|               | Κατηγορία 1           | Κατηγορία 2 | Κατηγορία 3          | Σύνολο                |
|---------------|-----------------------|-------------|----------------------|-----------------------|
| Ομολογίες     | 122.417.894,62        | -           | -                    | 122.417.894,62        |
| Swaps         | -                     | -           | -6.284.685,00        | -6.284.685,00         |
| <b>Σύνολο</b> | <b>122.417.894,62</b> | <b>-</b>    | <b>-6.284.685,00</b> | <b>116.133.209,62</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.

Αθήνα, 27.08.2025

Ο Θεματοφύλακας  
ALPHA BANK

Η Εταιρεία Διαχείρισης  
ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

Α.Ν. ΑΡΟΤΣΙΔΟΥ

Ε.Α. ΓΡΥΠΑΙΟΥ

Π.Δ. ΑΝΤΩΝΟΠΟΥΛΟΣ

Π.Δ. ΜΠΛΕΤΣΑ  
Αρ. Αδείας Ο.Ε.Ε. Α' Τάξεως 114762

## 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 PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ»

## Έκθεση Ελέγχου επί της Εξαμηνιαίας Έκθεσης Διαχείρισης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου «ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ»

### Γνώμη

Έχουμε ελέγξει την Εξαμηνιαία Έκθεση Διαχείρισης της εξάμηνης περιόδου που έληξε την 30<sup>η</sup> Ιουνίου 2025 (01.01.2025-30.06.2025) του Αμοιβαίου Κεφαλαίου «ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ» (η Έκθεση Διαχείρισης), που καταρτίστηκε από τη διαχειρίστρια της περιουσίας του εταιρεία «ΑΛΦΑ ASSET MANAGEMENT ΜΟΝΟΠΡΟΣΩΠΗ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΕΩΣ ΑΜΟΙΒΑΙΩΝ ΚΕΦΑΛΑΙΩΝ» (η Διαχειρίστρια Εταιρεία) και περιλαμβάνει την Χρηματοοικονομική θέση (Ισολογισμό), την κατάσταση εξέλιξης των καθαρών περιουσιακών στοιχείων περιόδου, καθώς και τις λοιπές πληροφορίες, τα στοιχεία και τις επεξηγηματικές σημειώσεις του ως άνω Αμοιβαίου Κεφαλαίου.

Κατά τη γνώμη μας, η ανωτέρω Έκθεση Διαχείρισης παρουσιάζει εύλογα, από κάθε ουσιώδη άποψη, τη χρηματοοικονομική θέση του Αμοιβαίου Κεφαλαίου «ALPHA PROSPERITY II 90-130 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ» κατά την 30<sup>η</sup> Ιουνίου 2025 και τη χρηματοοικονομική του επίδοση για την εξάμηνη περίοδο που έληξε την ημερομηνία αυτή, σύμφωνα με τις σχετικές διατάξεις του Ν. 4308/2014, περιλαμβάνοντας τις πληροφορίες, τα στοιχεία και τις επεξηγηματικές σημειώσεις 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, όπως ισχύουν.

### Βάση γνώμης

Διενεργήσαμε τον έλεγχο μας σύμφωνα με τα Διεθνή Πρότυπα Ελέγχου (ΔΠΕ), όπως αυτά έχουν ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία. Οι ευθύνες μας, σύμφωνα με τα πρότυπα αυτά περιγράφονται περαιτέρω στην παράγραφο της έκθεσής μας «Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισης».

Είμαστε ανεξάρτητοι από την Διαχειρίστρια Εταιρεία, και από το διαχειριζόμενο από αυτή Αμοιβαίο Κεφάλαιο καθ' όλη τη διάρκεια του διορισμού μας, σύμφωνα με τον Κώδικα Δεοντολογίας για Επαγγελματίες Ελεγκτές του Συμβουλίου Διεθνών Προτύπων Δεοντολογίας Ελεγκτών, όπως αυτός έχει ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία και τις απαιτήσεις δεοντολογίας που σχετίζονται με τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισης στην Ελλάδα και έχουμε εκπληρώσει τις δεοντολογικές μας υποχρεώσεις σύμφωνα με τις απαιτήσεις της ισχύουσας νομοθεσίας και του προαναφερόμενου Κώδικα Δεοντολογίας. 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 Διαχείρισης όπου γίνεται αναφορά στο πλαίσιο κατάρτισής της σύμφωνα με τις υφιστάμενες κανονιστικές διατάξεις.

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

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

Η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας έχει την ευθύνη για την κατάρτιση και εύλογη παρουσίαση της Έκθεσης Διαχείρισης, 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 όπως ισχύουν και για εκείνες τις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου, που η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας καθορίζει ως απαραίτητες, ώστε να καθίσταται δυνατή η κατάρτιση Έκθεσης Διαχείρισης, απαλλαγμένης από ουσιώδες σφάλμα, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος.

## Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισης

Οι στόχοι μας είναι να αποκτήσουμε εύλογη διασφάλιση για το κατά πόσο η Έκθεση Διαχείρισης 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, όπως αυτά έχουν ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία, 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 Διαχείρισης.

Ως καθήκον του ελέγχου, σύμφωνα με τα ΔΠΕ όπως αυτά έχουν ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία, ασκούμε επαγγελματική κρίση και διατηρούμε επαγγελματικό σκεπτικισμό καθ' όλη τη διάρκεια του ελέγχου. Επίσης:

- Εντοπίζουμε και αξιολογούμε τους κινδύνους ουσιώδους σφάλματος στην Έκθεση Διαχείρισης, 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 δικλίδων εσωτερικού ελέγχου.
- Κατανοούμε τις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου που σχετίζονται με τον έλεγχο, με σκοπό το σχεδιασμό ελεγκτικών διαδικασιών κατάλληλων για τις περιστάσεις, αλλά όχι με σκοπό την διατύπωση γνώμης επί της αποτελεσματικότητας των δικλίδων εσωτερικού ελέγχου της Διαχειρίστριας Εταιρείας.
- Αξιολογούμε την καταλληλότητα των λογιστικών πολιτικών και μεθόδων που χρησιμοποιήθηκαν και το εύλογο των λογιστικών εκτιμήσεων και των σχετικών γνωστοποιήσεων που έγιναν από τη διοίκηση.
- Αξιολογούμε τη συνολική παρουσίαση, τη δομή και το περιεχόμενο της Έκθεσης Διαχείρισης, συμπεριλαμβανομένων των γνωστοποιήσεων, καθώς και το κατά πόσο η Έκθεση Διαχείρισης απεικονίζει τις υποκείμενες συναλλαγές και τα γεγονότα με τρόπο που επιτυγχάνεται η εύλογη παρουσίαση.

Μεταξύ άλλων θεμάτων, κοινοποιούμε στη διοίκηση, το σχεδιαζόμενο εύρος και το χρονοδιάγραμμα του ελέγχου, καθώς και σημαντικά ευρήματα του ελέγχου, συμπεριλαμβανομένων όποιων σημαντικών ελλείψεων στις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου εντοπίζουμε κατά τη διάρκεια του ελέγχου μας.

Αθήνα, 28 Αυγούστου 2025

Η Ορκωτός Ελεγκτής Λογιστής

## Φωτεινή Δ. Γιαννοπούλου

A.M. ΣΟΕΛ: 24031

Deloitte Ανώνυμη Εταιρία Ορκωτών Ελεγκτών Λογιστών

Φραγκοκκλησιάς 3α & Γρανικού, 151 25 Μαρούσι

A.M. ΣΟΕΛ: E 120