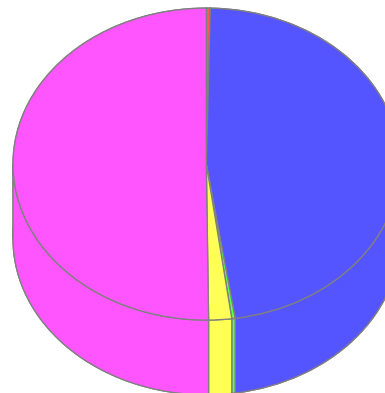




ALPHA MULTI-ASSET PROTECT 85 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ. Ε.Κ. 378/24.6.2021

Σύνθεση Ενεργητικού	Αξία	% NAV
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού	452.451,82	0,64
Μέσα Χρηματαγοράς Εσωτερικού	66.145.820,00	94,09
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού	392.481,89	0,56
Μέσα Χρηματαγοράς Εξωτερικού	2.680.342,00	3,81
Παράγωγα Προϊόντα Εξωτερικού	70.197.983,55	99,86
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις	-69.571.041,07	-98,97
Σύνολα	70.298.038,19	100,00



- Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού
- Μέσα Χρηματαγοράς Εσωτερικού
- Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού
- Μέσα Χρηματαγοράς Εξωτερικού
- Παράγωγα Προϊόντα Εξωτερικού

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

ALPHA MULTI-ASSET PROTECT 85 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ. Ε.Κ. 378/24.6.2021

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					452.451,82	0,64
Alpha Services and Holdings SA					452.451,82	0,64
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		452.451,8200	1,00000000	452.451,82	452.451,82	0,64
Μέσα Χρηματαγοράς Εσωτερικού					66.145.820,00	94,09
HELLENIC T-BILL	GR0004132586	4.000.000,0000	99,29000000	3.971.600,00	3.971.600,00	5,65
HELLENIC T-BILL	GR0000230368	19.500.000,0000	99,63000000	19.427.850,00	19.427.850,00	27,64
HELLENIC T-BILL	GR0002252212	1.400.000,0000	99,76000000	1.396.640,00	1.396.640,00	1,99
HELLENIC T-BILL	GR0004133592	8.000.000,0000	98,34000000	7.867.200,00	7.867.200,00	11,19
HELLENIC T-BILL	GR0002257260	9.000.000,0000	98,46000000	8.861.400,00	8.861.400,00	12,61
HELLENIC T-BILL	GR0002254234	7.000.000,0000	99,06000000	6.934.200,00	6.934.200,00	9,86
HELLENIC T-BILL	GR0000229352	12.000.000,0000	99,97000000	11.996.400,00	11.996.400,00	17,07
HELLENIC T-BILL	GR0002253228	1.900.000,0000	99,37000000	1.888.030,00	1.888.030,00	2,69
HELLENIC T-BILL	GR0004134608	3.900.000,0000	97,50000000	3.802.500,00	3.802.500,00	5,41
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					392.481,89	0,56
CITIBANK					392.481,89	0,56
Cash CITIBANK (EUR)		392.481,8900	1,00000000	392.481,89	392.481,89	0,56
Μέσα Χρηματαγοράς Εξωτερικού					2.680.342,00	3,81
FRENCH DISCOUNT T-BILL	FR0128227735	700.000,0000	99,46600000	696.262,00	696.262,00	0,99
FRENCH DISCOUNT T-BILL	FR0128227776	1.000.000,0000	98,55500000	985.550,00	985.550,00	1,40
FRENCH DISCOUNT T-BILL	FR0127921064	1.000.000,0000	99,85300000	998.530,00	998.530,00	1,42
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εξωτερικού					70.197.983,55	99,86
JPM SYNTH.BASKET SWAP Ref D2736029	OTC JPM	73.052.143,2000	0,96090000	70.197.983,55	70.197.983,55	99,86
Σύνολο Ενεργητικού					139.869.079,26	198,97
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					-69.571.041,07	-98,97
Καθαρό Ενεργητικό					70.298.038,19	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA MULTI-ASSET PROTECT 85 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ.Εγκρ. Ε.Κ. 378/24.6.2021

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
Λοιπά Ομόλογα										
GR0004132586	HELLENIC REPUBLIC	07/06/2023	07/06/2024	0,0000	EUR	4.000.000,00	99,29	3.971.600,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0004133592	HELLENIC REPUBLIC	06/09/2023	06/09/2024	0,0000	EUR	8.000.000,00	98,34	7.867.200,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0002253228	HELLENIC REPUBLIC	29/11/2023	31/05/2024	0,0000	EUR	1.900.000,00	99,37	1.888.030,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0000229352	HELLENIC REPUBLIC	03/01/2024	05/04/2024	0,0000	EUR	12.000.000,0	99,97	11.996.400,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0000230368	HELLENIC REPUBLIC	31/01/2024	07/05/2024	0,0000	EUR	19.500.000,0	99,63	19.427.850,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0002252212	HELLENIC REPUBLIC	25/10/2023	26/04/2024	0,0000	EUR	1.400.000,00	99,76	1.396.640,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0004134608	HELLENIC REPUBLIC	06/12/2023	06/12/2024	0,0000	EUR	3.900.000,00	97,50	3.802.500,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0002257260	HELLENIC REPUBLIC	21/02/2024	23/08/2024	0,0000	EUR	9.000.000,00	98,46	8.861.400,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0002254234	HELLENIC REPUBLIC	27/12/2023	28/06/2024	0,0000	EUR	7.000.000,00	99,06	6.934.200,00	BOG	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
FR0127921064	FRANCE (GOVT OF)	24/04/2023	17/04/2024	0,0000	EUR	1.000.000,00	99,85	998.530,00	BGN	AA
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
FR0128227776	FRANCE (GOVT OF)	12/02/2024	21/08/2024	0,0000	EUR	1.000.000,00	98,56	985.550,00	BGN	AA
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
FR0128227735	FRANCE (GOVT OF)	19/02/2024	23/05/2024	0,0000	EUR	700.000,00	99,47	696.262,00	BGN	AA
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										