

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2023



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ.Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					587.100,29	1,70
Alpha Services and Holdings SA					587.100,29	1,70
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		587.100,2900	1,00000000	587.100,29	587.100,29	1,70
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					28.838.237,50	83,48
Σταθερού Επιτοκίου					28.838.237,50	83,48
HELLENIC REPUBLIC	GR0124039737	2.000.000,0000	104,75000000	2.095.000,00	2.095.000,00	6,06
HELLENIC REPUBLIC	GR0124036709	2.650.000,0000	86,46700000	2.291.375,50	2.291.375,50	6,63
HELLENIC REPUBLIC	GR0124035693	1.750.000,0000	101,56400000	1.777.370,00	1.777.370,00	5,15
HELLENIC REPUBLIC	GR0128016731	2.500.000,0000	81,97800000	2.049.450,00	2.049.450,00	5,93
PRODEA REAL ESTATE INV	GRC5091217D	100.000,0000	85,20000000	85.200,00	85.200,00	0,25
AEGEAN AIRLINES SA	GRC4951193D	200.000,0000	97,86000000	195.720,00	195.720,00	0,57
HELLENIC REPUBLIC	GR0124038721	11.000.000,0000	85,47700000	9.402.470,00	9.402.470,00	27,22
HELLENIC REPUBLIC	GR0124037715	12.000.000,0000	80,13400000	9.616.080,00	9.616.080,00	27,84
ATTICA ENTERPRICE HOLDIN	GRC1441197B	1.200.000,0000	98,50000000	1.182.000,00	1.182.000,00	3,42
HELLENIC REPUBLIC	GR0124034688	50.000,0000	100,92400000	50.462,00	50.462,00	0,15
TERNA ENERGY FINANCE	GRC813119AD	100.000,0000	93,11000000	93.110,00	93.110,00	0,27
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					46.581,75	0,13
CITIBANK					46.581,75	0,13
Cash CITIBANK (EUR)		46.581,7500	1,00000000	46.581,75	46.581,75	0,13
Μέσα Χρηματαγοράς Εξωτερικού					398.148,00	1,15
FRENCH DISCOUNT T-BILL	FR0127613489	400.000,0000	99,53700000	398.148,00	398.148,00	1,15
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					6.346.859,50	18,37
Σταθερού Επιτοκίου					6.346.859,50	18,37
ALPHA BANK SA	XS2562213145	3.000.000,0000	102,31900000	3.069.570,00	3.069.570,00	8,89
EUROBANK SA	XS2338193019	1.100.000,0000	87,77800000	965.558,00	965.558,00	2,80
REPUBLIC OF CYPRUS	XS2610236445	250.000,0000	102,77100000	256.927,50	256.927,50	0,74
EUROBANK SA	XS2385386029	1.800.000,0000	85,78800000	1.544.184,00	1.544.184,00	4,47

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: 13/07/2023 03:31:40

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2023



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ.Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
EUROBANK SA	XS2579816146	500.000,0000	102,12400000	510.620,00	510.620,00	1,48
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					-1.273.850,00	-3,69
SWAP ALPHA 14/12/22 - 14/12/2032 (ΕΕ 104)	OTC	34.900.000,0000	-0,03650000	-1.273.850,00	-1.273.850,00	-3,69
Σύνολο Ενεργητικού					34.943.077,04	101,16
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					-399.289,20	-1,16
Καθαρό Ενεργητικό					34.543.787,84	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2023



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ.Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (30/06/2023)

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	1.800.000,00	85,79	1.544.184,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 03/14/2027@100.00</i>										
XS2579816146	Eurobank Ergasias SA	19/01/2023	26/01/2029	7,0000	EUR	500.000,00	102,12	510.620,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ call date 26/1/28 @100</i>										
XS2338193019	Eurobank Ergasias SA	05/05/2021	05/05/2027	2,0000	EUR	1.100.000,00	87,78	965.558,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 05/05/26@100.00</i>										
XS2562213145	Alpha Services and Holdings SA	16/12/2022	16/06/2027	7,5000	EUR	3.000.000,00	102,32	3.069.570,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 16/6/2026 @100</i>										
GR0124036709	HELLENIC REPUBLIC	18/06/2020	18/06/2030	1,5000	EUR	2.650.000,00	86,47	2.291.375,50	BGN	BB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124038721	HELLENIC REPUBLIC	26/01/2022	18/06/2032	1,7500	EUR	11.000.000,0	85,48	9.402.470,00	BGN	BB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124039737	HELLENIC REPUBLIC	17/01/2023	15/06/2033	4,2500	EUR	2.000.000,00	104,75	2.095.000,00	BGN	BB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124034688	HELLENIC REPUBLIC	05/12/2017	30/01/2028	3,7500	EUR	50.000,00	100,92	50.462,00	BGN	BB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124037715	HELLENIC REPUBLIC	05/02/2021	18/06/2031	0,7500	EUR	12.000.000,0	80,13	9.616.080,00	BGN	BB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0128016731	HELLENIC REPUBLIC	04/02/2020	04/02/2035	1,8750	EUR	2.500.000,00	81,98	2.049.450,00	BGN	BB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124035693	HELLENIC REPUBLIC	12/03/2019	12/03/2029	3,8750	EUR	1.750.000,00	101,56	1.777.370,00	BGN	BB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GRC4951193D4	Aegean Airlines SA	12/03/2019	12/03/2026	3,6000	EUR	200.000,00	97,86	195.720,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
GRC813119AD1	TERNA ENERGY FINANCE	22/10/2019	22/10/2026	2,6000	EUR	100.000,00	93,11	93.110,00	EXCH	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: 13/07/2023 03:31:41

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2023



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ.Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (30/06/2023)										
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>										
GRC1441197B3	ATTICA ENTERPRISE HOLDIN	26/07/2019	26/07/2024	3,4000	EUR	1.200.000,00	98,50	1.182.000,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
GRC5091217D9	PRODEA REAL ESTATE INV	20/07/2021	20/07/2028	2,3000	EUR	100.000,00	85,20	85.200,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ GREEN CALL 20/07/2025 @ 102.30</i>										
XS2610236445	REPUBLIC OF CYPRUS	13/04/2023	13/04/2033	4,1250	EUR	250.000,00	102,77	256.927,50	BGN	BBB-
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
Λοιπά Ομόλογα										
FR0127613489	FRANCE (GOVT OF)	13/03/2023	23/08/2023	0,0000	EUR	400.000,00	99,54	398.148,00	BGN	AA
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										