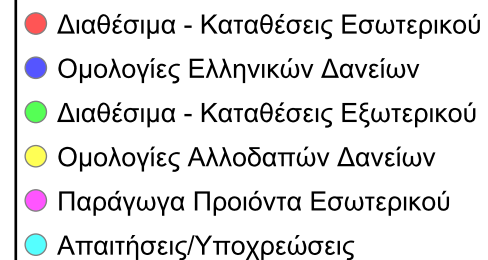
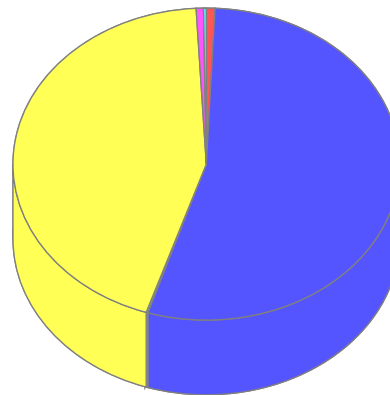




ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ. Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Αξία	% NAV
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού	262.838,58	0,72
Όμολογίες Ελληνικών Δανείων	19.774.964,10	54,17
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού	52.601,75	0,14
Όμολογίες Αλλοδαπών Δανείων	16.106.383,00	44,12
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού	222.458,42	0,61
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις	84.502,36	0,23
Σύνολα	36.503.748,21	100,00



Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA BANCASSURANCE EE104 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					262.838,58	0,72
Alpha Services and Holdings SA					262.838,58	0,72
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		262.838,5800	1,00000000	262.838,58	262.838,58	0,72
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					19.774.964,10	54,17
Σταθερού Επιτοκίου					19.774.964,10	54,17
HELLENIC REPUBLIC	GR0124035693	250.000,0000	104,20700000	260.517,50	260.517,50	0,71
AEGEAN AIRLINES SA	GRC4951193D	200.000,0000	98,60000000	197.200,00	197.200,00	0,54
ATTICA ENTERPRICE HOLDIN	GRC1441197B	1.200.000,0000	99,30000000	1.191.600,00	1.191.600,00	3,26
HELLENIC REPUBLIC	GR0124037715	11.600.000,0000	84,85000000	9.842.600,00	9.842.600,00	26,96
HELLENIC REPUBLIC	GR0124036709	150.000,0000	91,24100000	136.861,50	136.861,50	0,37
HELLENIC REPUBLIC	GR0124038721	8.400.000,0000	89,53900000	7.521.276,00	7.521.276,00	20,60
HELLENIC REPUBLIC	GR0128015725	50.000,0000	104,86200000	52.431,00	52.431,00	0,14
TERNA ENERGY FINANCE	GRC813119AD	100.000,0000	94,30010000	94.300,10	94.300,10	0,26
HELLENIC REPUBLIC	GR0124039737	50.000,0000	107,62000000	53.810,00	53.810,00	0,15
PRODEA REAL ESTATE INV	GRC5091217D	100.000,0000	89,70000000	89.700,00	89.700,00	0,25
AUTOHELLAS TOURIST AND	GRC3371241B	334.000,0000	100,20000000	334.668,00	334.668,00	0,92
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					52.601,75	0,14
CITIBANK					52.601,75	0,14
Cash CITIBANK (EUR)		52.601,7500	1,00000000	52.601,75	52.601,75	0,14
Μέσα Χρηματαγοράς Εξωτερικού					0,00	0,00
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					16.106.383,00	44,12
Σταθερού Επιτοκίου					16.106.383,00	44,12
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2756298639	3.000.000,0000	100,06700000	3.002.010,00	3.002.010,00	8,22
EUROBANK SA	XS2579816146	300.000,0000	108,71500000	326.145,00	326.145,00	0,89
ING GROEP NV	XS2764264607	1.000.000,0000	100,51900000	1.005.190,00	1.005.190,00	2,75
ALPHA BANK SA	XS2761146468	1.550.000,0000	100,23800000	1.553.689,00	1.553.689,00	4,26
UNICREDIT SPA	XS2433141947	1.600.000,0000	86,55200000	1.384.832,00	1.384.832,00	3,79

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 12:00:49

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ. Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ALPHA BANK SA	XS2640904319	1.000.000,0000	108,28400000	1.082.840,00	1.082.840,00	2,97
REPUBLIC OF CYPRUS	XS2610236445	250.000,0000	107,18800000	267.970,00	267.970,00	0,73
BNP PARIBAS	FR0014009LQ	1.500.000,0000	88,94500000	1.334.175,00	1.334.175,00	3,65
EUROBANK SA	XS2724510792	1.000.000,0000	105,05900000	1.050.590,00	1.050.590,00	2,88
DEUTSCHE BANK AG	DE000DL19VU	1.500.000,0000	83,82400000	1.257.360,00	1.257.360,00	3,44
PIRAEUS BANK SA	XS2728486536	2.000.000,0000	107,12000000	2.142.400,00	2.142.400,00	5,87
EUROBANK SA	XS2385386029	1.800.000,0000	94,39900000	1.699.182,00	1.699.182,00	4,65
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					222.458,42	0,61
SWAP ALPHA 14/12/22 - 14/12/2032 (ΕΕ 104)	OTC	34.900.000,0000	0,00640000	222.458,42	222.458,42	0,61
<i>Σύνολο Ενεργητικού</i>					36.419.245,85	99,77
<i>Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις</i>					84.502,36	0,23
<i>Καθαρό Ενεργητικό</i>					36.503.748,21	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA BANCASSURANCE EE104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ. Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

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										
XS2579816146	Eurobank Ergasias SA	19/01/2023	26/01/2029	7,0000	EUR	300.000,00	108,72	326.145,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 26/1/28 @100</i>										
XS2385386029	Eurobank Ergasias SA	14/09/2021	14/03/2028	2,2500	EUR	1.800.000,00	94,40	1.699.182,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 03/14/2027@100.00</i>										
XS2724510792	Eurobank Ergasias SA	21/11/2023	28/11/2029	5,8750	EUR	1.000.000,00	105,06	1.050.590,00	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	3.000.000,00	100,07	3.002.010,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 29/01/2028@100.00</i>										
XS2761146468	Alpha Services and Holdings SA	05/02/2024	12/05/2030	5,0000	EUR	1.550.000,00	100,24	1.553.689,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 12/05/2029@100.00</i>										
XS2640904319	Alpha Services and Holdings SA	20/06/2023	27/06/2029	6,8750	EUR	1.000.000,00	108,28	1.082.840,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 27/06/2028@100</i>										
FR0014009LQ8	BNP PARIBAS	31/03/2022	07/04/2032	2,1000	EUR	1.500.000,00	88,94	1.334.175,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2728486536	PIRAEUS FINANCIAL	28/11/2023	05/12/2029	6,7500	EUR	2.000.000,00	107,12	2.142.400,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 05/12/2028@100.00</i>										
GR0124035693	HELLENIC REPUBLIC	12/03/2019	12/03/2029	3,8750	EUR	250.000,00	104,21	260.517,50	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124037715	HELLENIC REPUBLIC	05/02/2021	18/06/2031	0,7500	EUR	11.600.000,0	84,85	9.842.600,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124039737	HELLENIC REPUBLIC	17/01/2023	15/06/2033	4,2500	EUR	50.000,00	107,62	53.810,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0128015725	HELLENIC REPUBLIC	05/12/2017	30/01/2033	3,9000	EUR	50.000,00	104,86	52.431,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124038721	HELLENIC REPUBLIC	26/01/2022	18/06/2032	1,7500	EUR	8.400.000,00	89,54	7.521.276,00	BGN	BB+

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 12:00:49

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ104 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αρ. Εγκρ. Ε.Κ. 426 / 04.10.2022

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>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124036709	HELLENIC REPUBLIC	18/06/2020	18/06/2030	1,5000	EUR	150.000,00	91,24	136.861,50	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GRC4951193D4	Aegean Airlines SA	12/03/2019	12/03/2026	3,6000	EUR	200.000,00	98,60	197.200,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
GRC813119AD1	TERNA ENERGY FINANCE	22/10/2019	22/10/2026	2,6000	EUR	100.000,00	94,30	94.300,10	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
DE000DL19VU0	DEUTSCHE BANK	08/02/2021	17/02/2032	1,3750	EUR	1.500.000,00	83,82	1.257.360,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/02/2031@100.00</i>										
GRC1441197B3	ATTICA ENTERPRISE HOLDIN	26/07/2019	26/07/2024	3,4000	EUR	1.200.000,00	99,30	1.191.600,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
GRC5091217D9	PRODEA REAL ESTATE INV	20/07/2021	20/07/2028	2,3000	EUR	100.000,00	89,70	89.700,00	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	1.000.000,00	100,52	1.005.190,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 12/08/28@100</i>										
XS2433141947	UNICREDIT SPA	11/01/2022	18/01/2032	1,6250	EUR	1.600.000,00	86,55	1.384.832,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2610236445	REPUBLIC OF CYPRUS	13/04/2023	13/04/2033	4,1250	EUR	250.000,00	107,19	267.970,00	BGN	BBB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</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>										