

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2023



ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αποφ. Ε.Κ. 425 / 04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					119.858,80	0,15
Alpha Services and Holdings SA					119.858,80	0,15
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		119.858,8000	1,00000000	119.858,80	119.858,80	0,15
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					64.143.029,50	80,84
Σταθερού Επιτοκίου					64.143.029,50	80,84
HELLENIC REPUBLIC	GR0124034688	20.250.000,0000	100,92400000	20.437.110,00	20.437.110,00	25,76
HELLENIC REPUBLIC	GR0124035693	20.750.000,0000	101,56400000	21.074.530,00	21.074.530,00	26,56
HELLENIC REPUBLIC	GR0118019679	50.000,0000	95,23200000	47.616,00	47.616,00	0,06
HELLENIC REPUBLIC	GR0118020685	19.000.000,0000	94,62100000	17.977.990,00	17.977.990,00	22,66
HELLENIC REPUBLIC	GR0124036709	50.000,0000	86,46700000	43.233,50	43.233,50	0,05
HELLENIC REPUBLIC	GR0114032577	5.000.000,0000	91,25100000	4.562.550,00	4.562.550,00	5,75
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					252.799,99	0,32
CITIBANK					252.799,99	0,32
Cash CITIBANK (EUR)		252.799,9900	1,00000000	252.799,99	252.799,99	0,32
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					13.234.136,00	16,68
Σταθερού Επιτοκίου					13.234.136,00	16,68
EUROBANK SA	XS2579816146	1.000.000,0000	102,12400000	1.021.240,00	1.021.240,00	1,29
PUBLIC POWER CORP	XS2314265237	100.000,0000	97,20700000	97.207,00	97.207,00	0,12
ALPHA BANK SA	XS2388172855	400.000,0000	85,82100000	343.284,00	343.284,00	0,43
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2237982769	800.000,0000	93,33700000	746.696,00	746.696,00	0,94
MOTOR OIL (HELLAS) SA	XS2364001151	100.000,0000	93,55200000	93.552,00	93.552,00	0,12
ALPHA BANK SA	XS2562213145	6.500.000,0000	102,31900000	6.650.735,00	6.650.735,00	8,38
EUROBANK SA	XS2338193019	2.400.000,0000	87,77800000	2.106.672,00	2.106.672,00	2,66
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA	XS2400040460	500.000,0000	91,79800000	458.990,00	458.990,00	0,58
EUROBANK SA	XS2385386029	2.000.000,0000	85,78800000	1.715.760,00	1.715.760,00	2,16
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					1.873.760,00	2,36

ALPHA ASSET MANAGEMENT A.E.D.A.K. (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 Report Line 5 Text

Print Date: 13/07/2023 03:31:59



ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αποφ. Ε.Κ. 425 / 04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
SWAP ALPHA BANK 7/12/2022 - 7/12/2027 (PROSPERITY)	OTC	78.400.000,0000	0,02390000	1.873.760,00	1.873.760,00	2,36
Σύνολο Ενεργητικού					79.623.584,29	100,36
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					-282.497,84	-0,36
Καθαρό Ενεργητικό					79.341.086,45	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2023



ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αποφ. Ε.Κ. 425 / 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										
XS2579816146	Eurobank Ergasias SA	19/01/2023	26/01/2029	7,0000	EUR	1.000.000,00	102,12	1.021.240,00	BGN	BB-
- ETAIPIKO call date 26/1/28 @100										
XS2385386029	Eurobank Ergasias SA	14/09/2021	14/03/2028	2,2500	EUR	2.000.000,00	85,79	1.715.760,00	BGN	BB-
- ETAIPIKO CALL 03/14/2027@100.00										
XS2338193019	Eurobank Ergasias SA	05/05/2021	05/05/2027	2,0000	EUR	2.400.000,00	87,78	2.106.672,00	BGN	BB-
- ETAIPIKO CALL 05/05/26@100.00										
XS2237982769	National Bank of Greece SA	08/10/2020	08/10/2026	2,7500	EUR	800.000,00	93,34	746.696,00	BGN	BB-
- ETAIPIKO CALL 8/10/2025@100.00 Senior Unsecured										
XS2562213145	Alpha Services and Holdings SA	16/12/2022	16/06/2027	7,5000	EUR	6.500.000,00	102,32	6.650.735,00	BGN	BB-
- ETAIPIKO CALL 16/6/2026 @100										
XS2388172855	Alpha Services and Holdings SA	23/09/2021	23/03/2028	2,5000	EUR	400.000,00	85,82	343.284,00	BGN	BB-
- ETAIPIKO CALL 23/3/2027 @100										
XS2400040460	PIRAEUS FINANCIAL	03/11/2021	03/11/2027	3,8750	EUR	500.000,00	91,80	458.990,00	BGN	B+
- ETAIPIKO COLLATERAL: SUBORDINATED CALL 03/11/2026 @100										
GR0118020685	HELLENIC REPUBLIC	22/04/2020	22/04/2027	2,0000	EUR	19.000.000,0	94,62	17.977.990,00	BGN	BB
- ΚΡΑΤΙΚΟ										
GR0124036709	HELLENIC REPUBLIC	18/06/2020	18/06/2030	1,5000	EUR	50.000,00	86,47	43.233,50	BGN	BB
- ΚΡΑΤΙΚΟ										
GR0124034688	HELLENIC REPUBLIC	05/12/2017	30/01/2028	3,7500	EUR	20.250.000,0	100,92	20.437.110,00	BGN	BB
- ΚΡΑΤΙΚΟ										
GR0118019679	HELLENIC REPUBLIC	23/07/2019	23/07/2026	1,8750	EUR	50.000,00	95,23	47.616,00	BGN	BB
- ΚΡΑΤΙΚΟ										
GR0114032577	HELLENIC REPUBLIC	12/05/2021	12/02/2026	0,0000	EUR	5.000.000,00	91,25	4.562.550,00	BGN	BB
- ΚΡΑΤΙΚΟ										
GR0124035693	HELLENIC REPUBLIC	12/03/2019	12/03/2029	3,8750	EUR	20.750.000,0	101,56	21.074.530,00	BGN	BB

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 Report Line 5 Text

Print Date: 13/07/2023 03:31:59

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2023



ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

Αποφ. Ε.Κ. 425 / 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

- ΚΡΑΤΙΚΟ

XS2314265237	Public Power Corp SA	18/03/2021	30/03/2026	4,3750	EUR	100.000,00	97,21	97.207,00	BGN	BB-
--------------	----------------------	------------	------------	--------	-----	------------	-------	-----------	-----	-----

- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 14/8/23 @101.94

XS2364001151	MOTOR OIL FINANCE PLC	19/07/2021	19/07/2026	2,1250	EUR	100.000,00	93,55	93.552,00	BGN	NR
--------------	-----------------------	------------	------------	--------	-----	------------	-------	-----------	-----	----

- ΕΤΑΙΡΙΚΟ