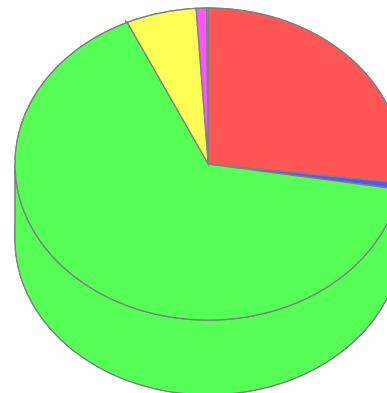




## ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 425/04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Αξία	% NAV
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων	19.798.992,50	26,94
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού	474.044,91	0,65
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων	48.155.483,00	65,53
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού	4.321.675,03	5,88
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις	642.816,77	0,87
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού	92.059,69	0,13
Σύνολα	73.485.071,90	100,00



- Ομολογίες Ελληνικών Δανείων
- Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού
- Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων
- Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού
- Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις
- Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού

## Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



## ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

## ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 425/04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
<b>ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					92.059,69	0,13
Alpha Services and Holdings SA					92.059,69	0,13
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		92.059,6900	1,00000000	92.059,69	92.059,69	0,13
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					19.798.992,50	26,94
Σταθερού Επιτοκίου					19.798.992,50	26,94
HELLENIC REPUBLIC	GR0118019679	50.000,0000	98,20400000	49.102,00	49.102,00	0,07
HELLENIC REPUBLIC	GR0114032577	100.000,0000	95,09200000	95.092,00	95.092,00	0,13
HELLENIC REPUBLIC	GR0118020685	11.800.000,0000	97,96900000	11.560.342,00	11.560.342,00	15,73
HELLENIC REPUBLIC	GR0124034688	7.700.000,0000	103,17700000	7.944.629,00	7.944.629,00	10,81
HELLENIC REPUBLIC	GR0124036709	50.000,0000	91,24100000	45.620,50	45.620,50	0,06
HELLENIC REPUBLIC	GR0124035693	100.000,0000	104,20700000	104.207,00	104.207,00	0,14
<b>ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ</b>						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					474.044,91	0,65
CITIBANK					474.044,91	0,65
Cash CITIBANK (EUR)		474.044,9100	1,00000000	474.044,91	474.044,91	0,65
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					48.155.483,00	65,53
Σταθερού Επιτοκίου					48.155.483,00	65,53
PUBLIC POWER CORP	XS2359929812	3.500.000,0000	96,06400000	3.362.240,00	3.362.240,00	4,58
EUROBANK SA	XS2579816146	1.000.000,0000	108,71500000	1.087.150,00	1.087.150,00	1,48
UNICREDIT SPA	XS2577053825	2.000.000,0000	104,16500000	2.083.300,00	2.083.300,00	2,83
BNP PARIBAS	FR0013508710	2.000.000,0000	90,45200000	1.809.040,00	1.809.040,00	2,46
MACQUARIE GROUP LTD	XS2265371042	1.000.000,0000	89,16800000	891.680,00	891.680,00	1,21
BANK OF CYPRUS PCL	XS2648493570	1.200.000,0000	106,61100000	1.279.332,00	1.279.332,00	1,74
PIRAEUS BANK SA	XS2644936259	3.100.000,0000	106,68800000	3.307.328,00	3.307.328,00	4,50
ALPHA BANK SA	XS2640904319	4.900.000,0000	108,28400000	5.305.916,00	5.305.916,00	7,22
SOCIETE GENERALE	XS1718316281	1.500.000,0000	92,75700000	1.391.355,00	1.391.355,00	1,89
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA	XS2400040460	500.000,0000	97,83200000	489.160,00	489.160,00	0,67
TITAN GLOBAL FINANCE PLC	XS2199268470	100.000,0000	98,30900000	98.309,00	98.309,00	0,13

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 12:01:46

## Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET  
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

## ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 425/04.10.2022

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ALPHA BANK SA	XS2388172855	1.000.000,0000	93,89400000	938.940,00	938.940,00	1,28
INTESA SANPAOLO SPA	XS1785340172	2.000.000,0000	93,22200000	1.864.440,00	1.864.440,00	2,54
MYTILINEOS SA	XS2337604479	100.000,0000	95,97200000	95.972,00	95.972,00	0,13
ALPHA BANK SA	XS2586877446	200.000,0000	105,20200000	210.404,00	210.404,00	0,29
MORGAN STANLEY	XS2548080832	1.000.000,0000	104,01200000	1.040.120,00	1.040.120,00	1,42
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	XS2430998893	2.000.000,0000	90,45600000	1.809.120,00	1.809.120,00	2,46
BANCO COMERC PORTUGUES	PTBCPEOM00	1.000.000,0000	93,95000000	939.500,00	939.500,00	1,28
PIRAEUS BANK SA	XS2728486536	2.500.000,0000	107,12000000	2.678.000,00	2.678.000,00	3,64
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2756298639	1.000.000,0000	100,06700000	1.000.670,00	1.000.670,00	1,36
EUROBANK SA	XS2385386029	2.500.000,0000	94,39900000	2.359.975,00	2.359.975,00	3,21
EUROBANK SA	XS2724510792	3.100.000,0000	105,05900000	3.256.829,00	3.256.829,00	4,43
SANTANDER UK GROUP HLDGS	XS2525226622	1.500.000,0000	99,44600000	1.491.690,00	1.491.690,00	2,03
UBS GROUP AG	CH0595205524	2.000.000,0000	88,29000000	1.765.800,00	1.765.800,00	2,40
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2558592932	5.100.000,0000	107,96300000	5.506.113,00	5.506.113,00	7,49
DEUTSCHE BANK AG	DE000A30V5C	2.000.000,0000	104,65500000	2.093.100,00	2.093.100,00	2,85
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					4.321.675,03	5,88
SWAP ALPHA BANK 7/12/2022 - 7/12/2027 (PROSPERITY)	OTC	78.400.000,0000	0,05510000	4.321.675,03	4.321.675,03	5,88
Σύνολο Ενεργητικού					72.842.255,13	99,13
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					642.816,77	0,87
Καθαρό Ενεργητικό					73.485.071,90	100,00

## Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET  
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

## ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 425/04.10.2022

## 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
<b>Ομόλογα Σταθερού Επιτοκίου</b>										
XS2724510792	Eurobank Ergasias SA	21/11/2023	28/11/2029	5,8750	EUR	3.100.000,00	105,06	3.256.829,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 21/11/28 @100</i>										
XS2579816146	Eurobank Ergasias SA	19/01/2023	26/01/2029	7,0000	EUR	1.000.000,00	108,72	1.087.150,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 26/1/28 @100</i>										
XS2385386029	Eurobank Ergasias SA	14/09/2021	14/03/2028	2,2500	EUR	2.500.000,00	94,40	2.359.975,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 03/14/2027@100.00</i>										
XS2558592932	National Bank of Greece SA	22/11/2022	22/11/2027	7,2500	EUR	5.100.000,00	107,96	5.506.113,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 22/11/26 @100</i>										
XS2756298639	National Bank of Greece SA	22/01/2024	29/01/2029	4,5000	EUR	1.000.000,00	100,07	1.000.670,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 29/01/2028@100.00</i>										
XS2586877446	Alpha Services and Holdings SA	08/02/2023	13/02/2029	6,7500	EUR	200.000,00	105,20	210.404,00	BVAL	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 13/02/2028 @100.00</i>										
XS2388172855	Alpha Services and Holdings SA	23/09/2021	23/03/2028	2,5000	EUR	1.000.000,00	93,89	938.940,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 23/3/2027 @100</i>										
XS2640904319	Alpha Services and Holdings SA	20/06/2023	27/06/2029	6,8750	EUR	4.900.000,00	108,28	5.305.916,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 27/06/2028@100</i>										
FR0013508710	BNP PARIBAS	14/04/2020	17/04/2029	1,1250	EUR	2.000.000,00	90,45	1.809.040,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/04/2028 @100.00</i>										
XS2548080832	Morgan Stanley	18/10/2023	25/10/2028	4,8130	EUR	1.000.000,00	104,01	1.040.120,00	BGN	A
<i>- MAKE WHOLE @45.000 until 07/25/28/ CALL 10/25/27@100.00</i>										
XS2644936259	PIRAEUS FINANCIAL	06/07/2023	13/07/2028	7,2500	EUR	3.100.000,00	106,69	3.307.328,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 13/07/2027@100.00</i>										
XS2728486536	PIRAEUS FINANCIAL	28/11/2023	05/12/2029	6,7500	EUR	2.500.000,00	107,12	2.678.000,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 05/12/2028@100.00</i>										
XS2400040460	PIRAEUS FINANCIAL	03/11/2021	03/11/2027	3,8750	EUR	500.000,00	97,83	489.160,00	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

Print Date: 10/04/2024 12:01:46

## Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET  
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

## ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 425/04.10.2022

## 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>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 03/11/2026 @100</i>										
GR0124036709	HELLENIC REPUBLIC	18/06/2020	18/06/2030	1,5000	EUR	50.000,00	91,24	45.620,50	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0114032577	HELLENIC REPUBLIC	12/05/2021	12/02/2026	0,0000	EUR	100.000,00	95,09	95.092,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124035693	HELLENIC REPUBLIC	12/03/2019	12/03/2029	3,8750	EUR	100.000,00	104,21	104.207,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0118019679	HELLENIC REPUBLIC	23/07/2019	23/07/2026	1,8750	EUR	50.000,00	98,20	49.102,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0118020685	HELLENIC REPUBLIC	22/04/2020	22/04/2027	2,0000	EUR	11.800.000,0	97,97	11.560.342,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GR0124034688	HELLENIC REPUBLIC	05/12/2017	30/01/2028	3,7500	EUR	7.700.000,00	103,18	7.944.629,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
XS2337604479	Mytilineos Holdings SA	28/04/2021	30/10/2026	2,2500	EUR	100.000,00	95,97	95.972,00	BGN	BB+
<i>- MAKE WHOLE @50.000000 until 04/30/26/ GREEN BOND</i>										
XS2359929812	Public Power Corp SA	21/07/2021	31/07/2028	3,3750	EUR	3.500.000,00	96,06	3.362.240,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ Sustainability Linked Indic., MAKE WHOLE @50 UNTIL 31/07/2024 CALL 31/7/24 @101.69</i>										
XS1785340172	INTESA SAN PAOLO SPA	12/03/2018	20/03/2028	1,7500	EUR	2.000.000,00	93,22	1.864.440,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2199268470	TITAN GLOBAL FINANCE PLC	09/07/2020	09/07/2027	2,7500	EUR	100.000,00	98,31	98.309,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 09/01/2027@100</i>										
DE000A30V5C3	DEUTSCHE BANK	04/01/2023	11/01/2029	5,3750	EUR	2.000.000,00	104,66	2.093.100,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 01/11/28 @100.00</i>										
CH0595205524	UBS Group AG	16/02/2021	24/02/2028	0,2500	EUR	2.000.000,00	88,29	1.765.800,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS1718316281	Societe Generale SA	08/11/2017	13/01/2028	1,3750	EUR	1.500.000,00	92,76	1.391.355,00	BGN	BBB

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: 10/04/2024 12:01:46

## Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET  
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

## ALPHA PROSPERITY I 90-140 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 425/04.10.2022

## 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>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2648493570	BANK OF CYPRUS PCL	18/07/2023	25/07/2028	7,3750	EUR	1.200.000,00	106,61	1.279.332,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 07/25/27@100</i>										
XS2577053825	UNICREDIT SPA	10/01/2023	17/01/2029	4,8000	EUR	2.000.000,00	104,16	2.083.300,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/1/28 @100</i>										
XS2430998893	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	05/01/2022	14/01/2029	0,8750	EUR	2.000.000,00	90,46	1.809.120,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 14/01/2028@100.00</i>										
XS2265371042	MACQUARIE GROUP LTD	25/11/2020	03/03/2028	0,3500	EUR	1.000.000,00	89,17	891.680,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
PTBCPEOM0069	BANCO COMERC PORTUGUES	29/09/2021	07/04/2028	1,7500	EUR	1.000.000,00	93,95	939.500,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 07/04/2027@100.00</i>										
XS2525226622	SANTANDER UK GROUP	18/08/2022	25/08/2028	3,5300	EUR	1.500.000,00	99,45	1.491.690,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 25/08/2027@100.00</i>										