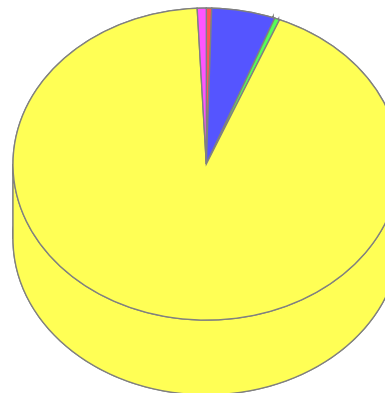




ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ105 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 451/06.04.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Αξία	% NAV
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού	461.384,32	0,45
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων	5.503.997,00	5,40
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού	439.969,77	0,43
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων	96.402.735,22	94,63
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού	-1.719.355,51	-1,69
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις	781.044,82	0,77
Σύνολα	101.869.775,62	100,00



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

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ105 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 451/06.04.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					461.384,32	0,45
Alpha Services and Holdings SA					461.384,32	0,45
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		461.384,3200	1,00000000	461.384,32	461.384,32	0,45
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					5.503.997,00	5,40
Σταθερού Επιτοκίου					5.503.997,00	5,40
HELLENIC REPUBLIC	GR0114033583	5.300.000,0000	103,84900000	5.503.997,00	5.503.997,00	5,40
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					439.969,77	0,43
CITIBANK					439.969,77	0,43
Cash CITIBANK (EUR)		439.969,7700	1,00000000	439.969,77	439.969,77	0,43
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					96.402.735,22	94,63
Σταθερού Επιτοκίου					96.402.735,22	94,63
HSBC HOLDINGS PLC	XS2388491289	5.200.000,0000	87,71100000	4.560.972,00	4.560.972,00	4,48
SANTANDER UK GROUP HLDGS	XS2525226622	2.500.000,0000	99,44600000	2.486.150,00	2.486.150,00	2,44
INTESA SANPAOLO SPA	XS1785340172	4.500.000,0000	93,22200000	4.194.990,00	4.194.990,00	4,12
SANTAN CONSUMER FINANCE	XS2747776487	1.800.000,0000	100,79600000	1.814.328,00	1.814.328,00	1,78
DEUTSCHE BANK AG	DE000A30V5C	4.000.000,0000	104,65500000	4.186.200,00	4.186.200,00	4,11
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2756298639	4.000.000,0000	100,06700000	4.002.680,00	4.002.680,00	3,93
SOCIETE GENERALE	XS1718316281	2.800.000,0000	92,75700000	2.597.196,00	2.597.196,00	2,55
UNICREDIT SPA	XS2577053825	4.000.000,0000	104,16500000	4.166.600,00	4.166.600,00	4,09
MORGAN STANLEY	XS2548080832	4.000.000,0000	104,01200000	4.160.480,00	4.160.480,00	4,08
EUROBANK SA	XS2579816146	8.100.000,0000	108,71500000	8.805.915,00	8.805.915,00	8,64
BANCO COMERC PORTUGUES	PTBCPEOM00	4.800.000,0000	93,95000000	4.509.600,00	4.509.600,00	4,43
PUBLIC POWER CORP	XS2359929812	800.000,0000	96,06400000	768.512,00	768.512,00	0,75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	XS2430998893	4.800.000,0000	90,45600000	4.341.888,00	4.341.888,00	4,26
BANK OF CYPRUS PCL	XS2355059168	3.300.000,0000	94,78600000	3.127.938,00	3.127.938,00	3,07
BNP PARIBAS	FR0013508710	5.000.000,0000	90,45200000	4.522.600,00	4.522.600,00	4,44
GOLDMAN SACHS GROUP INC	XS2441552192	5.000.000,0000	90,53100000	4.526.550,00	4.526.550,00	4,44

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 12:05:26

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ105 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 451/06.04.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
UBS GROUP AG	CH0595205524	5.000.000,0000	88,29000000	4.414.500,00	4.414.500,00	4,33
ALPHA BANK SA	XS2640904319	8.400.000,0000	108,28400000	9.095.856,00	9.095.856,00	8,93
BANK OF AMERICA CORP	XS2634687912	2.500.000,0000	102,56900000	2.564.225,00	2.564.225,00	2,52
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA	XS2400040460	9.000.000,0000	97,83200000	8.804.880,00	8.804.880,00	8,64
BANK OF CYPRUS PCL	XS2648493570	5.602.000,0000	106,61100000	5.972.348,22	5.972.348,22	5,86
ING GROEP NV	XS2624976077	2.700.000,0000	102,90100000	2.778.327,00	2.778.327,00	2,73
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					-1.719.355,51	-1,69
SWAP ALPHA 20/06/2022 - 20/6/2028 (ΕΕ 105)	OTC (SWAPA)	98.000.000,0000	-0,01750000	-1.719.355,51	-1.719.355,51	-1,69
Σύνολο Ενεργητικού					101.088.730,80	99,23
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					781.044,82	0,77
Καθαρό Ενεργητικό					101.869.775,62	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024



ALPHA BANCASSURANCE EE105 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 451/06.04.2023

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	8.100.000,00	108,72	8.805.915,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 26/1/28 @100</i>										
XS2756298639	National Bank of Greece SA	22/01/2024	29/01/2029	4,5000	EUR	4.000.000,00	100,07	4.002.680,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 29/01/2028@100.00</i>										
XS2640904319	Alpha Services and Holdings SA	20/06/2023	27/06/2029	6,8750	EUR	8.400.000,00	108,28	9.095.856,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 27/06/2028@100</i>										
FR0013508710	BNP PARIBAS	14/04/2020	17/04/2029	1,1250	EUR	5.000.000,00	90,45	4.522.600,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/04/2028 @100.00</i>										
XS2548080832	Morgan Stanley	18/10/2023	25/10/2028	4,8130	EUR	4.000.000,00	104,01	4.160.480,00	BGN	A
<i>- MAKE WHOLE @45.000 until 07/25/28/ CALL 10/25/27@100.00</i>										
XS2634687912	Bank of America Corp	05/06/2023	12/06/2028	4,1340	EUR	2.500.000,00	102,57	2.564.225,00	BGN	A
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ MAKE WHOLE @30,00 until 12/12/2023 CALL</i>										
XS2441552192	Goldman Sachs Group Inc/The	01/02/2022	07/02/2029	1,2500	EUR	5.000.000,00	90,53	4.526.550,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 11/07/28@100.00</i>										
XS2400040460	PIRAEUS FINANCIAL	03/11/2021	03/11/2027	3,8750	EUR	9.000.000,00	97,83	8.804.880,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 03/11/2026 @100</i>										
GR0114033583	HELLENIC REPUBLIC	29/03/2023	15/06/2028	3,8750	EUR	5.300.000,00	103,85	5.503.997,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
XS2359929812	Public Power Corp SA	21/07/2021	31/07/2028	3,3750	EUR	800.000,00	96,06	768.512,00	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	4.500.000,00	93,22	4.194.990,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
DE000A30V5C3	DEUTSCHE BANK	04/01/2023	11/01/2029	5,3750	EUR	4.000.000,00	104,66	4.186.200,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 01/11/28 @100.00</i>										
XS2388491289	HSBC Holdings PLC	17/09/2021	24/09/2029	0,6410	EUR	5.200.000,00	87,71	4.560.972,00	BGN	A-

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 12:05:26

Πίνακας Επενδύσεων την 29/03/2024

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ105 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 451/06.04.2023

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 MAKE WHOLE @20.000 until 09/24/28/ CALL 09/24/28@100.00</i>										
CH0595205524	UBS Group AG	16/02/2021	24/02/2028	0,2500	EUR	5.000.000,00	88,29	4.414.500,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS1718316281	Societe Generale SA	08/11/2017	13/01/2028	1,3750	EUR	2.800.000,00	92,76	2.597.196,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2624976077	ING Groep NV	15/05/2023	23/05/2029	4,5000	EUR	2.700.000,00	102,90	2.778.327,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 23/05/2028@100</i>										
XS2355059168	BANK OF CYPRUS PCL	16/06/2021	24/06/2027	2,5000	EUR	3.300.000,00	94,79	3.127.938,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 24/06/2026 @ 100.00</i>										
XS2648493570	BANK OF CYPRUS PCL	18/07/2023	25/07/2028	7,3750	EUR	5.602.000,00	106,61	5.972.348,22	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 07/25/27@100</i>										
XS2577053825	UNICREDIT SPA	10/01/2023	17/01/2029	4,8000	EUR	4.000.000,00	104,16	4.166.600,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/1/28 @100</i>										
XS2430998893	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	05/01/2022	14/01/2029	0,8750	EUR	4.800.000,00	90,46	4.341.888,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 14/01/2028@100.00</i>										
PTBCPEOM0069	BANCO COMERC PORTUGUES	29/09/2021	07/04/2028	1,7500	EUR	4.800.000,00	93,95	4.509.600,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 07/04/2027@100.00</i>										
XS2747776487	SANTAN CONSUMER FINANCE	09/01/2024	17/01/2029	3,7500	EUR	1.800.000,00	100,80	1.814.328,00	BGN	A
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2525226622	SANTANDER UK GROUP	18/08/2022	25/08/2028	3,5300	EUR	2.500.000,00	99,45	2.486.150,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 25/08/2027@100.00</i>										