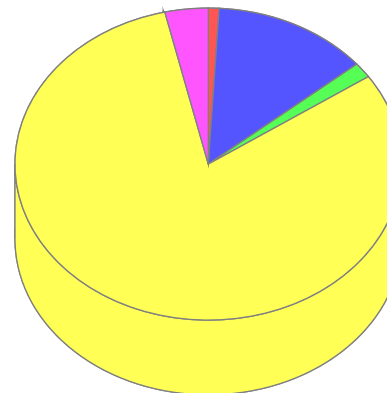




ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ106 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ.477/10.8.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Αξία	% NAV
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού	274.906,67	0,89
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων	4.012.042,00	13,06
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού	488.206,31	1,59
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων	24.877.959,00	80,96
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού	1.110.140,00	3,61
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις	-35.629,60	-0,12
Σύνολα	30.727.624,38	100,00



- Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού
- Ομολογίες Ελληνικών Δανείων
- Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού
- Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων
- Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ106 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ.477/10.8.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					274.906,67	0,89
Alpha Services and Holdings SA					274.906,67	0,89
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		274.906,6700	1,00000000	274.906,67	274.906,67	0,89
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					4.012.042,00	13,06
Σταθερού Επιτοκίου					4.012.042,00	13,06
ΑEGEAN AIRLINES SA	GRC4951193D4	1.000.000,0000	97,80000000	978.000,00	978.000,00	3,18
PRODEA REAL ESTATE INV	GRC5091217D9	650.000,0000	89,88000000	584.220,00	584.220,00	1,90
HELLENIC REPUBLIC	GR0114033583	1.700.000,0000	102,41600000	1.741.072,00	1.741.072,00	5,67
TERNA ENERGY FINANCE	GRC813119AD1	750.000,0000	94,50000000	708.750,00	708.750,00	2,31
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					488.206,31	1,59
CITIBANK					488.206,31	1,59
Cash CITIBANK (EUR)		488.206,3100	1,00000000	488.206,31	488.206,31	1,59
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					24.877.959,00	80,96
Σταθερού Επιτοκίου					24.877.959,00	80,96
PUBLIC POWER CORP	XS2359929812	1.400.000,0000	95,36900000	1.335.166,00	1.335.166,00	4,35
PIRAEUS BANK SA	XS2644936259	2.300.000,0000	106,72100000	2.454.583,00	2.454.583,00	7,99
BANCO COMERC PORTUGUES	PTBCPEOM0069	1.000.000,0000	94,14200000	941.420,00	941.420,00	3,06
BNP PARIBAS	FR0013508710	1.200.000,0000	90,30700000	1.083.684,00	1.083.684,00	3,53
HSBC HOLDINGS PLC	XS2388491289	1.200.000,0000	87,77600000	1.053.312,00	1.053.312,00	3,43
INTESA SANPAOLO SPA	XS1785340172	1.000.000,0000	93,32300000	933.230,00	933.230,00	3,04
BANK OF CYPRUS PCL	XS2648493570	2.400.000,0000	107,23700000	2.573.688,00	2.573.688,00	8,38
GOLDMAN SACHS GROUP INC	XS2441552192	1.200.000,0000	89,89700000	1.078.764,00	1.078.764,00	3,51
SANTANDER UK GROUP HLDGS	XS2525226622	1.200.000,0000	98,75900000	1.185.108,00	1.185.108,00	3,86
SANTAN CONSUMER FINANCE	XS2747776487	1.000.000,0000	100,27000000	1.002.700,00	1.002.700,00	3,26
ALPHA BANK SA	XS2724940619	2.500.000,0000	104,02300000	2.600.575,00	2.600.575,00	8,46
SOCIETE GENERALE	XS1718316281	200.000,0000	92,17100000	184.342,00	184.342,00	0,60
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2756298639	1.300.000,0000	99,73700000	1.296.581,00	1.296.581,00	4,22

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: 12/07/2024 05:09:03

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ106 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ.477/10.8.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
TITAN GLOBAL FINANCE PLC	XS2731293168	200.000,0000	99,95500000	199.910,00	199.910,00	0,65
EUROBANK SA	XS2579816146	2.400.000,0000	108,45300000	2.602.872,00	2.602.872,00	8,47
MORGAN STANLEY	XS2595028536	1.000.000,0000	103,01300000	1.030.130,00	1.030.130,00	3,35
UNICREDIT SPA	XS2577053825	1.000.000,0000	103,21500000	1.032.150,00	1.032.150,00	3,36
UBS GROUP AG	CH0595205524	1.200.000,0000	88,52700000	1.062.324,00	1.062.324,00	3,46
ING GROEP NV	XS2624976077	1.200.000,0000	102,28500000	1.227.420,00	1.227.420,00	3,99
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					1.110.140,00	3,61
SWAP ALPHA 02/11/2023 - 07/11/2028 (BANCASSURANCE ΕΕ106)	OTC (SWAP AB)	28.200.000,0000	0,03940000	1.110.140,00	1.110.140,00	3,61
Σύνολο Ενεργητικού					30.763.253,98	100,12
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					-35.629,60	-0,12
Καθαρό Ενεργητικό					30.727.624,38	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ106 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ.477/10.8.2023

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (30/06/2024)

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										
GRC4951193D4	Aegean Airlines SA	12/03/2019	12/03/2026	3,6000	EUR	1.000.000,00	97,80	978.000,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
GRC5091217D9	PRODEA REAL ESTATE INV	20/07/2021	20/07/2028	2,3000	EUR	650.000,00	89,88	584.220,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ GREEN CALL 20/07/2025 @ 102.30</i>										
GR0114033583	HELLENIC REPUBLIC	29/03/2023	15/06/2028	3,8750	EUR	1.700.000,00	102,42	1.741.072,00	BGN	BB+
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
GRC813119AD1	TERNA ENERGY FINANCE	22/10/2019	22/10/2026	2,6000	EUR	750.000,00	94,50	708.750,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2359929812	Public Power Corp SA	21/07/2021	31/07/2028	3,3750	EUR	1.400.000,00	95,37	1.335.166,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ Sustainability Linked Indic., MAKE WHOLE @50 UNTIL 31/07/2024 CALL 12/08/24 @101.69</i>										
XS2644936259	PIRAEUS FINANCIAL	06/07/2023	13/07/2028	7,2500	EUR	2.300.000,00	106,72	2.454.583,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 13/07/2027@100.00</i>										
PTBCPEOM0069	BANCO COMERC PORTUGUES	29/09/2021	07/04/2028	1,7500	EUR	1.000.000,00	94,14	941.420,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 07/04/2027@100.00</i>										
FR0013508710	BNP PARIBAS	14/04/2020	17/04/2029	1,1250	EUR	1.200.000,00	90,31	1.083.684,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/04/2028 @100.00</i>										
XS2388491289	HSBC Holdings PLC	17/09/2021	24/09/2029	0,6410	EUR	1.200.000,00	87,78	1.053.312,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ MAKE WHOLE @20.000 until 24/09/28/ CALL 24/09/28@100.00</i>										
XS1785340172	INTESA SAN PAOLO SPA	12/03/2018	20/03/2028	1,7500	EUR	1.000.000,00	93,32	933.230,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2648493570	BANK OF CYPRUS PCL	18/07/2023	25/07/2028	7,3750	EUR	2.400.000,00	107,24	2.573.688,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 25/07/27@100.00</i>										
XS2441552192	Goldman Sachs Group Inc/The	01/02/2022	07/02/2029	1,2500	EUR	1.200.000,00	89,90	1.078.764,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 07/11/28@100.00</i>										
XS2525226622	SANTANDER UK GROUP	18/08/2022	25/08/2028	3,5300	EUR	1.200.000,00	98,76	1.185.108,00	BGN	BBB+

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: 12/07/2024 05:09:03

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ106 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ.477/10.8.2023

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (30/06/2024)

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 25/08/2027@100.00</i>										
XS2747776487	SANTAN CONSUMER FINANCE	09/01/2024	17/01/2029	3,7500	EUR	1.000.000,00	100,27	1.002.700,00	BGN	A
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2724940619	Alpha Services and Holdings SA	17/11/2023	22/11/2029	6,5000	EUR	2.500.000,00	104,02	2.600.575,00	BVAL	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 22/11/2028@100.00</i>										
XS1718316281	Societe Generale SA	08/11/2017	13/01/2028	1,3750	EUR	200.000,00	92,17	184.342,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2756298639	National Bank of Greece SA	22/01/2024	29/01/2029	4,5000	EUR	1.300.000,00	99,74	1.296.581,00	BGN	BB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 29/01/2028@100.00</i>										
XS2731293168	TITAN GLOBAL FINANCE PLC	07/12/2023	13/06/2029	4,2500	EUR	200.000,00	99,96	199.910,00	BVAL	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CAL 13/12/2028@100.00</i>										
XS2579816146	Eurobank Ergasias SA	19/01/2023	26/01/2029	7,0000	EUR	2.400.000,00	108,45	2.602.872,00	BGN	BB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 26/1/28 @100</i>										
XS2595028536	Morgan Stanley	28/02/2023	02/03/2029	4,6560	EUR	1.000.000,00	103,01	1.030.130,00	BGN	A
<i>- MAKE WHOLE @30.000 until 12/02/28/ CALL 03/02/28@100.00</i>										
XS2577053825	UNICREDIT SPA	10/01/2023	17/01/2029	4,8000	EUR	1.000.000,00	103,22	1.032.150,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/1/28 @100</i>										
CH0595205524	UBS Group AG	16/02/2021	24/02/2028	0,2500	EUR	1.200.000,00	88,53	1.062.324,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ</i>										
XS2624976077	ING Groep NV	15/05/2023	23/05/2029	4,5000	EUR	1.200.000,00	102,28	1.227.420,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 23/05/2028@100</i>										