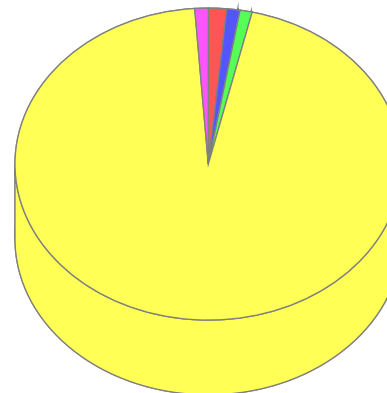




ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ107 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 512/28.12.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Αξία	% NAV
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού	565.265,78	1,55
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων	410.718,00	1,13
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού	376.443,64	1,03
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων	35.354.250,00	96,91
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού	-640.397,57	-1,76
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις	416.195,83	1,14
Σύνολα	36.482.475,68	100,00



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

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ107 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 512/28.12.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εσωτερικού					565.265,78	1,55
Alpha Services and Holdings SA					565.265,78	1,55
Cash Alpha Services and Holdings SA (EUR)		565.265,7800	1,00000000	565.265,78	565.265,78	1,55
Ομολογίες Ελληνικών Δανείων					410.718,00	1,13
Σταθερού Επιτοκίου					410.718,00	1,13
PRODEA REAL ESTATE INV	GRC5091217D9	135.000,0000	89,88000000	121.338,00	121.338,00	0,33
ELVALHALCOR HELLENIC COP	GRC281121BD8	318.000,0000	91,00000000	289.380,00	289.380,00	0,79
ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Διαθέσιμα - Καταθέσεις Εξωτερικού					376.443,64	1,03
CITIBANK					376.443,64	1,03
Cash CITIBANK (EUR)		376.443,6400	1,00000000	376.443,64	376.443,64	1,03
Ομολογίες Αλλοδαπών Δανείων					35.354.250,00	96,91
Σταθερού Επιτοκίου					35.354.250,00	96,91
NATIONAL BANK GREECE SA	XS2756298639	1.300.000,0000	99,73700000	1.296.581,00	1.296.581,00	3,55
PIRAEUS BANK SA	XS2728486536	3.000.000,0000	106,86300000	3.205.890,00	3.205.890,00	8,79
BUONI POLIENNALI DEL TES	IT0005566408	1.000.000,0000	102,50000000	1.025.000,00	1.025.000,00	2,81
UNICREDIT SPA	XS2588885025	1.200.000,0000	101,33700000	1.216.044,00	1.216.044,00	3,33
HELLENIC BANK PCL	XS2498640056	200.000,0000	100,18800000	200.376,00	200.376,00	0,55
BANK OF CYPRUS PCL	XS2801451571	3.300.000,0000	99,33000000	3.277.890,00	3.277.890,00	8,98
EUROBANK SA	XS2579816146	3.000.000,0000	108,45300000	3.253.590,00	3.253.590,00	8,92
STANDARD CHARTERED PLC	XS2407969885	1.500.000,0000	87,54300000	1.313.145,00	1.313.145,00	3,60
DEUTSCHE BANK AG	DE000A30VT06	1.400.000,0000	102,94600000	1.441.244,00	1.441.244,00	3,95
UNICAJA BANCO SA	ES0280907033	1.100.000,0000	103,47400000	1.138.214,00	1.138.214,00	3,12
UBS GROUP AG	CH1214797172	1.100.000,0000	112,83700000	1.241.207,00	1.241.207,00	3,40
ING GROEP NV	XS2281155254	1.500.000,0000	85,12800000	1.276.920,00	1.276.920,00	3,50
ALPHA BANK SA	XS2761146468	3.300.000,0000	100,08900000	3.302.937,00	3.302.937,00	9,05
BARCLAYS PLC	XS2373642102	1.500.000,0000	87,48500000	1.312.275,00	1.312.275,00	3,60
SOCIETE GENERALE	FR0014001GA9	1.500.000,0000	87,11000000	1.306.650,00	1.306.650,00	3,58

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: 15/07/2024 10:44:37

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ107 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 512/28.12.2023

Σύνθεση Ενεργητικού	Isin	Ποσότητα	Τιμή	Αξία στο Νομ.	Αξία	% NAV
BANCO COMERC PORTUGUES	PTBCPEOM0069	1.500.000,0000	94,14200000	1.412.130,00	1.412.130,00	3,87
CAIXABANK SA	XS2649712689	1.200.000,0000	104,02200000	1.248.264,00	1.248.264,00	3,42
MEDIOBANCA DI CRED FIN	IT0005586893	1.300.000,0000	98,77500000	1.284.075,00	1.284.075,00	3,52
SANTAN CONSUMER FINANCE	XS2747776487	1.000.000,0000	100,27000000	1.002.700,00	1.002.700,00	2,75
COMMERZBANK AG	DE000CZ43ZN8	1.300.000,0000	103,86600000	1.350.258,00	1.350.258,00	3,70
NATWEST GROUP PLC	XS2307853098	1.500.000,0000	86,73100000	1.300.965,00	1.300.965,00	3,57
MORGAN STANLEY	XS2548080832	500.000,0000	103,47200000	517.360,00	517.360,00	1,42
PUBLIC POWER CORP	XS2359929812	1.500.000,0000	95,36900000	1.430.535,00	1.430.535,00	3,92
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
Παράγωγα Προϊόντα Εσωτερικού					-640.397,57	-1,76
SWAP ALPHA BANK 06.03.24-06.03.34 BANCASSURANCE 107	OTC (SWAP AB)	36.500.000,0000	-0,01750000	-640.397,57	-640.397,57	-1,76
Σύνολο Ενεργητικού					36.066.279,85	98,86
Απαιτήσεις/Υποχρεώσεις					416.195,83	1,14
Καθαρό Ενεργητικό					36.482.475,68	100,00

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024



ALPHA BANCASSURANCE ΕΕ107 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 512/28.12.2023

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										
GRC5091217D9	PRODEA REAL ESTATE INV	20/07/2021	20/07/2028	2,3000	EUR	135.000,00	89,88	121.338,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ GREEN CALL 20/07/2025 @ 102.30</i>										
GRC281121BD8	ELVALHALCOR HELLENIC	16/11/2021	16/11/2028	2,4500	EUR	318.000,00	91,00	289.380,00	EXCH	NR
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 16/11/2024 @ 101.00</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>										
XS2728486536	PIRAEUS FINANCIAL	28/11/2023	05/12/2029	6,7500	EUR	3.000.000,00	106,86	3.205.890,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 05/12/2028@100.00</i>										
IT0005566408	BUONI POLIENNALI DEL TES	28/09/2023	01/02/2029	4,1000	EUR	1.000.000,00	102,50	1.025.000,00	BGN	BBB
<i>- ΚΡΑΤΙΚΟ</i>										
XS2588885025	UNICREDIT SPA	09/02/2023	16/02/2029	4,4500	EUR	1.200.000,00	101,34	1.216.044,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 16/02/2028@100.00</i>										
XS2498640056	HELLENIC BANK PCL	15/07/2022	15/07/2025	9,0000	EUR	200.000,00	100,19	200.376,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 15/07/24@100.00</i>										
XS2801451571	BANK OF CYPRUS PCL	24/04/2024	02/05/2029	5,0000	EUR	3.300.000,00	99,33	3.277.890,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 2/05/2028@100,00</i>										
XS2579816146	Eurobank Ergasias SA	19/01/2023	26/01/2029	7,0000	EUR	3.000.000,00	108,45	3.253.590,00	BGN	BB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 26/1/28 @100</i>										
XS2407969885	STANDARD CHARTERED PLC	10/11/2021	17/11/2029	0,8000	EUR	1.500.000,00	87,54	1.313.145,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 17/11/2028@100.00</i>										
DE000A30VT06	DEUTSCHE BANK	25/08/2022	05/09/2030	5,0000	EUR	1.400.000,00	102,95	1.441.244,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 05/09/2029@100</i>										
ES0280907033	UNICAJA BANCO SA	13/02/2023	21/02/2029	5,1250	EUR	1.100.000,00	103,47	1.138.214,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 21/02/2028@100.00</i>										
CH1214797172	UBS Group AG	09/11/2022	01/03/2029	7,7500	EUR	1.100.000,00	112,84	1.241.207,00	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: 15/07/2024 10:44:37

Πίνακας Επενδύσεων την 30/06/2024



ALPHA BANCASSURANCE EE107 ΣΥΝΘΕΤΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ

ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 512/28.12.2023

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 01/03/2028@100.00</i>										
XS2281155254	ING Groep NV	04/01/2021	01/02/2030	0,2500	EUR	1.500.000,00	85,13	1.276.920,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 1/02/2029@100,00</i>										
XS2761146468	Alpha Services and Holdings SA	05/02/2024	12/05/2030	5,0000	EUR	3.300.000,00	100,09	3.302.937,00	BGN	BB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 12/05/2029@100.00</i>										
XS2373642102	BARCLAYS PLC	02/08/2021	09/08/2029	0,5770	EUR	1.500.000,00	87,48	1.312.275,00	BGN	BBB+
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ MAKE WHOLE@20.00 until 9/08/2028 call</i>										
FR0014001GA9	Societe Generale SA	05/01/2021	12/06/2029	0,5000	EUR	1.500.000,00	87,11	1.306.650,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 12/06/2028@100.00</i>										
PTBCPEOM0069	BANCO COMERC PORTUGUES	29/09/2021	07/04/2028	1,7500	EUR	1.500.000,00	94,14	1.412.130,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 07/04/2027@100.00</i>										
XS2649712689	CAIXABANK SA	11/07/2023	19/07/2029	5,0000	EUR	1.200.000,00	104,02	1.248.264,00	BGN	BBB
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 19/07/2028@100.00</i>										
IT0005586893	MEDIOBANCA DI CRED FIN	12/03/2024	04/07/2030	3,8750	EUR	1.300.000,00	98,78	1.284.075,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 4/07/2029@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>										
DE000CZ43ZN8	COMMERZBANK AG	11/01/2023	18/01/2030	5,1250	EUR	1.300.000,00	103,87	1.350.258,00	BGN	BBB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 18/01/2029 @100.00</i>										
XS2307853098	NATWEST GROUP PLC	23/02/2021	26/02/2030	0,7800	EUR	1.500.000,00	86,73	1.300.965,00	BGN	A-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ CALL 26/02/2029@100.00</i>										
XS2548080832	Morgan Stanley	18/10/2023	25/10/2028	4,8130	EUR	500.000,00	103,47	517.360,00	BGN	A
<i>- MAKE WHOLE @45.000 until 25/07/28/ CALL 25/10/27@100.00</i>										
XS2359929812	Public Power Corp SA	21/07/2021	31/07/2028	3,3750	EUR	1.500.000,00	95,37	1.430.535,00	BGN	BB-
<i>- ΕΤΑΙΡΙΚΟ Sustainability Linked Indic., MAKE WHOLE @50 UNTIL 31/07/2024 CALL 12/08/24 @101.69</i>										