



ALPHA ΑΜΟΙΒΑΙΑ ΚΕΦΑΛΑΙΑ

ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ: ALPHA BANK Α.Ε.

ΕΤΗΣΙΑ ΕΚΘΕΣΗ 2023

ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ
ΜΙΚΤΟ

ΑΠΡΙΛΙΟΣ 2024

ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ
ΑΠΟΦ. Ε.Κ 402/03.01.2022
ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ: ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ. (ΑΡ.Γ.Ε.ΜΗ. 920101000)
ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ: ALPHA BANK Α.Ε.
ΕΤΗΣΙΑ ΕΚΘΕΣΗ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ ΚΑΤΑ ΤΗΝ 31.12.2023
(Αρ. 77 Ν.4099/12 - Φ.Ε.Κ. 250/Α/ 20.12.2012, Ν.4308/2014)

ΕΙΔΟΣ ΑΞΙΟΓΡΑΦΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ / ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΤΙΜΗ ΜΟΝΑΔΟΣ ΣΕ ΝΟΜΙΣΜΑ ΑΝΑΦΟΡΑΣ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ ΤΟΥ ΣΥΝΟΛΟΥ ΤΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ	ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ ΤΟΥ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ
ΑΝΑΛΥΤΙΚΗ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΗ ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ (Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)					
ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ					
ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ					
ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ					
ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α					
ΑΚΙΝΗΤΗ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑ					
TRADE ESTATES REAL ESTATE IN	1.000.000	1,7600	<u>1.760.000,00</u> 1.760.000,00	2,66 % 2,66 %	2,69 % 2,69 %
ΒΙΟΜΗΧΑΝΙΚΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ					
ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ Α.Ε.	46.000	36,7000	<u>1.688.200,00</u> 1.688.200,00	2,56 % 2,56 %	2,58 % 2,58 %
ΕΜΠΟΡΙΟ					
JUMBO ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ (ΚΟ)	28.200	25,1200	<u>708.384,00</u> 708.384,00	1,07 % 1,07 %	1,08 % 1,08 %
ΚΑΤΑΣΚΕΥΕΣ ΚΑΙ ΥΛΙΚΑ ΚΑΤΑΣΚΕΥΩΝ					
ΕΛΛΑΚΤΩΡ Α.Ε. (ΚΟ)	175.000	2,5500	<u>446.250,00</u> 446.250,00	0,68 % 0,68 %	0,68 % 0,68 %
ΠΕΤΡΕΛΑΙΟ ΚΑΙ ΑΕΡΙΟ					
ΜΟΤΟΡ ΟΙΛ(ΕΛΛΑΣ) ΔΙΥΛ.ΚΟΡΙΝΘΟΥ Α.Ε.(ΚΟ)	35.000	23,7600	<u>831.600,00</u> 831.600,00	1,26 % 1,26 %	1,27 % 1,27 %
ΠΡΟΣΩΠΙΚΑ ΚΑΙ ΟΙΚΙΑΚΑ ΑΓΑΘΑ					
ΑΥΤΟHELLAS ΑΝΩΝ ΤΟΥΡ & ΕΜΠ ΕΤΑΙΡΕΙΑ (ΚΟ)	143.200	12,7800	<u>1.830.096,00</u> 1.830.096,00	2,77 % 2,77 %	2,80 % 2,80 %
ΤΑΞΙΔΙΑ ΚΑΙ ΑΝΑΨΥΧΗ					
ΟΠΑΠ Α.Ε. (ΚΟ)	219.991	15,3700	<u>3.381.261,67</u> 3.381.261,67	5,12 % 5,12 %	5,17 % 5,17 %
ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΑ					
QUEST ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε	70.000	5,6200	<u>393.400,00</u> 393.400,00	0,60 % 0,60 %	0,60 % 0,60 %
ΤΗΛΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΕΣ					
ΟΤΕ Α.Ε. (ΚΟ)	80.000	12,9000	<u>1.032.000,00</u> 1.032.000,00	1,56 % 1,56 %	1,58 % 1,58 %
ΥΠΗΡΕΣΙΕΣ ΚΟΙΝΗΣ ΩΦΕΛΕΙΑΣ					
ΤΕΡΝΑ ΕΝΕΡΓΕΙΑΚΗ Α.Β.Ε.Τ.Ε (ΚΟ)	156.000	15,9000	<u>2.480.400,00</u> 2.480.400,00	3,76 % 3,76 %	3,79 % 3,79 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α			<u>14.551.591,67</u>	22,04 %	22,24 %
ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ					
ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ ΕΤΑΙΡΙΚΑ					
PRODEA REAL ESTATE INV - GRC5091217D9	782.000	87,5000	684.250,00	1,04 %	1,05 %
ELVALHALCOR HELLENIC COP - GRC281121BD8	57.000	90,0000	51.300,00	0,08 %	0,08 %
GEK TERNA HLD ESTATE - GRC1451184D4	600.000	98,6806	592.083,60	0,90 %	0,91 %
ATTICA ENTERPRICE HOLDIN - GRC1441197B3	700.000	98,8000	691.600,00	1,05 %	1,06 %
TERNA ENERGY FINANCE - GRC813119AD1	480.000	92,3000	443.040,00	0,67 %	0,68 %
COSTAMARE PARTICIPATIONS - GRC5211214B5	200.000	95,0000	190.000,00	0,29 %	0,29 %
AEGEAN AIRLINES SA - GRC4951193D4	494.000	97,4000	481.156,00	0,73 %	0,74 %
LAMDA DEVELOPMENT - GRC2451207D1	400.000	93,2500	<u>373.000,00</u>	0,56 %	0,57 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			<u>3.506.429,60</u>	5,32 %	5,38 %
ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			<u>18.058.021,27</u>	27,36 %	27,62 %
ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ					
ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑ ΑΛΛΟΔΑΠΗΣ					
ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΘΗΝΩΝ					
TITAN CEMENT INTERNATIONAL S.A.	54.780	21,4500	1.175.031,00	1,78 %	1,80 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑ			<u>1.175.031,00</u>	1,78 %	1,80 %

ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ

ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ TREASURY-BILLS

FRENCH DISCOUNT T-BILL - FR0127613497	4.800.000	99,7890	4.789.872,00	7,25 %	7,33 %
FRENCH DISCOUNT T-BILL - FR0127921064	5.000.000	98,9080	4.945.400,00	7,49 %	7,57 %
DUTCH TREASURY CERT - NL0015001MS4	2.800.000	99,4260	<u>2.783.928,00</u>	4,21 %	4,26 %
			12.519.200,00	18,95 %	19,16 %
			12.519.200,00	18,95 %	19,16 %

ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ

ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ

ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ ΕΤΑΙΡΙΚΑ ΣΕ EUR

INTRALOT CAPITAL LUX - XS1685702794	129.127	98,7880	127.561,98	0,19 %	0,20 %
HELLENIC PETROLEUM FINAN - XS2060691719	800.000	97,0320	776.256,00	1,18 %	1,19 %
ALPHA BANK A.E - XS2111230285	2.600.000	97,3520	2.531.152,00	3,83 %	3,87 %
ALPHA BANK A.E - XS2307437629	900.000	97,1350	874.215,00	1,32 %	1,34 %
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA - XS2400040460	300.000	95,7470	287.241,00	0,43 %	0,44 %
EUROBANK ERG SVCS HLDGS - XS2562543442	4.200.000	111,7760	4.694.592,00	7,11 %	7,18 %
PIRAEUS FINANCIAL HLDGS - XS2354777265	3.000.000	97,7120	2.931.360,00	4,44 %	4,48 %
BANK OF CYPRUS PCL - XS2355059168	1.900.000	91,8400	1.744.960,00	2,64 %	2,67 %
ALPHA SERV & HLDGS - XS2583633966	2.100.000	107,7840	2.263.464,00	3,43 %	3,46 %
HELLENIC BANK PCL - XS2597995112	2.200.000	109,3510	2.405.722,00	3,64 %	3,68 %
BANK OF CYPRUS HOLDINGS - XS2333239692	2.300.000	97,6500	2.245.950,00	3,40 %	3,44 %
BANK OF CYPRUS PCL - XS2648493570	500.000	102,5200	512.600,00	0,78 %	0,78 %
NATIONAL BANK GREECE SA - XS2595343059	1.500.000	106,0920	1.591.380,00	2,41 %	2,43 %
PUBLIC POWER CORP - XS2359929812	800.000	93,7810	750.248,00	1,14 %	1,15 %
MYTILINEOS SA - XS2337604479	400.000	94,9750	379.900,00	0,58 %	0,58 %
NATIONAL BANK GREECE SA - XS2028846363	1.975.000	101,3390	2.001.445,25	3,03 %	3,06 %
TITAN GLOBAL FINANCE PLC - XS2199268470	400.000	97,6960	390.784,00	0,59 %	0,60 %
PUBLIC POWER CORP - XS2314265237	700.000	99,4660	696.262,00	1,05 %	1,07 %
HELLENIC BANK PCL - XS2498640056	200.000	102,1780	204.356,00	0,31 %	0,31 %
SAFE BULKERS PARTICIP - GRC8261222B1	200.000	93,9000	187.800,00	0,28 %	0,29 %
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA - XS2121408996	2.700.000	97,7080	2.638.116,00	3,98 %	4,03 %
MOTOR OIL (HELLAS) SA - XS2364001151	550.000	94,6470	520.558,50	0,79 %	0,80 %
FRIGO DEBTCO PLC - XS2603999264	365.214	46,9070	<u>171.310,93</u>	0,26 %	0,26 %
			30.927.234,66	46,81 %	47,31 %

ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ

ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ

ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ

ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ

ΔΙΑΦΟΡΩΝ ΧΩΡΩΝ ΣΕ EUR

FRIGO NEWCO 1 LIMITED	600	0,0010	0,60	0,00 %	0,00 %
			<u>0,60</u>	<u>0,00 %</u>	<u>0,00 %</u>
			0,60	0,00 %	0,00 %

ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΤΟΧΕΣ ΜΗ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ

ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ

	Ξ.Ν.	Τιμή Ξ.Ν.	Τρέχουσα αξία σε EUR		
ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ					
ΜΕΤΑΒΑΤΙΚΟΙ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ			781.928,75	1,18 %	1,20 %
ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΠΡΑΞΕΩΝ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ ΣΕ EUR			169.035,63	0,26 %	0,26 %
ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΠΡΑΞΕΩΝ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ ΣΕ USD	221.815,50	0,906289650	<u>201.029,09</u>	0,30 %	0,31 %
			1.151.993,47	1,74 %	1,77 %

ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ

ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΨΕΩΣ

ALPHA BANK EUR			2.208.776,49	3,34 %	3,38 %
CITIBANK EUR			<u>11.987,55</u>	0,02 %	0,02 %
			2.220.764,04	3,36 %	3,40 %

ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ

ΣΥΝΟΛΟ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ

ΠΙΣΤΩΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ			-559.496,97		-0,86 %
ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ ΑΠΟ ΦΟΡΟΥΣ			<u>-130.635,84</u>		-0,20 %
			-690.132,81		-1,06 %

ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ

			65.362.112,23		100,00 %
--	--	--	----------------------	--	-----------------

ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΧΡΗΣΕΩΣ 31.12.2023 Classic	27.723.326,22
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ ΣΕ ΚΥΚΛΟΦΟΡΙΑ Classic	2.541.878,226
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ Classic	10,9066
ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΧΡΗΣΕΩΣ 31.12.2023 Institutional	5.533,04
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ ΣΕ ΚΥΚΛΟΦΟΡΙΑ Institutional	500,000
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ Institutional	11,0661
ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΧΡΗΣΕΩΣ 31.12.2023 Classic D	37.633.252,97
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ ΣΕ ΚΥΚΛΟΦΟΡΙΑ Classic D	3.450.493,261
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ Classic D	10,9066

ΠΡΑΞΕΙΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΪΟΝΤΑ

ΟΝΟΜΑ ΣΥΜΒΟΛΑΙΟΥ	ΕΙΔΟΣ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΤΙΜΗ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ ΞΝ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ ΣΤΟ ΚΑΘΑΡΟ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟ
US 10YR NOTE (CBT) Mar24 (Πολυπληθισιαστής 1000, ισοτιμία USD:0,906289650172)	Short	-60,000	112,8906	-6.773.437,50	-6.138.696,30	-9,39 %

ΠΙΝΑΚΑΣ ΜΕΤΑΒΟΛΩΝ ΚΙΝΗΤΩΝ ΑΞΙΩΝ ΚΑΙ ΜΕΣΩΝ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ

ΜΕΤΑΞΥ 31.12.2023 ΚΑΙ 31.12.2022

(Αρ. 77 Ν.4099/12 - Φ.Ε.Κ. 250/Α/ 20.12.2012 & Απ. Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.5)

	31.12.2023	31.12.2022	ΜΕΤΑΒΟΛΗ
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ	65.362.112,23	19.875.396,22	
ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ	95,89 %	85,76 %	10,13 %
ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ			
ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α	22,24 %	14,93 %	7,31 %
ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ	5,38 %	19,46 %	-14,08 %
ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ	0,00 %	14,99 %	-14,99 %
ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ	19,16 %	0,00 %	19,16 %
ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ	47,31 %	35,47 %	11,84 %
ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α	1,80 %	0,91 %	0,89 %

ΑΝΑΛΥΤΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΧΡΗΣΕΩΣ 01.01.2023 - 31.12.2023

	ΑΞΙΑ ΣΕ EUR
A. ΠΡΟΣΟΔΟΙ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ	
I. Τόκοι Τραπεζικών Καταθέσεων	3.421,17
II. Έσοδα Ομολογιακών Δανείων	1.371.582,07
III. Μερισματα μετοχών εισηγμένων στο Χ.Α	498.741,92
IV. Μερισματα Μετοχών εισηγμένων σε Χρηματιστήρια Αλλοδαπής	<u>12.948,00</u>
	1.886.693,16
B. ΚΕΡΔΗ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	
I. Κέρδη από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων	801.972,66
II. Ζημιές από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων	<u>-426.427,79</u>
	375.544,87
Γ. ΠΡΑΞΕΙΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ	
I. Κέρδη από πράξεις σε Παράγωγα Χρηματοοικονομικά Προϊόντα	491.595,49
II. Ζημιές από πράξεις σε Χρηματοοικονομικά Προϊόντα	<u>-522.458,14</u>
	-30.862,65
Δ. ΕΚΤΑΚΤΑ ΚΑΙ ΑΝΟΡΓΑΝΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ	
I. Συναλλαγματικές Διαφορές	-1.037,07
II. Λοιπά έκτακτα και ανόργανα έσοδα	124,26
III. Λοιπά έκτακτα και ανόργανα έξοδα	<u>-74,91</u>
	-987,72
E. ΕΣΟΔΑ ΚΑΙ ΕΞΟΔΑ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ	
I. Έσοδα προηγούμενων χρήσεων	<u>-39,47</u>
	-39,47
ΣΤ. ΔΑΠΑΝΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ	
I. Αμοιβή Εταιρείας Διαχείρισης	-608.724,45
II. Αμοιβή Θεματοφυλακής	-28.409,03
III. Έξοδα Συμμετοχών και Χρεογράφων	-48.328,79
IV. Φόροι	-190.416,05
V. Τόκοι και Συναφή Έξοδα	-2.747,01
VI. Έξοδα άρθρου 9 του Κανονισμού	<u>-10.775,03</u>
	-889.400,36
ΚΕΡΔΗ ΧΡΗΣΕΩΣ 31.12.2023	<u>1.340.947,83</u>

ΠΙΝΑΚΑΣ ΠΗΓΩΝ ΠΡΟΕΛΕΥΣΕΩΣ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΚΑΙ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΑΠΟ 01.01.2023 - 31.12.2023
(Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)

	ΜΕΡΙΔΙΑ	ΑΞΙΑ ΣΕ EUR
I. ΚΕΦΑΛΑΙΑ ΜΕΡΙΔΙΟΥΧΩΝ		
ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Classic		
Μερίδια σε κυκλοφορία την 31.12.2022	947.915,283	9.539.555,19
Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.01.2023 - 31.12.2023	2.553.679,675	26.948.862,01
Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.01.2023 - 31.12.2023	-959.716,732	-10.130.564,91
Κέρδη Χρήσεως 01.01.2023 - 31.12.2023		<u>568.762,74</u>
Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 31.12.2023 ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Classic	2.541.878,226	26.926.615,03
ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Institutional		
Μερίδια σε κυκλοφορία την 31.12.2022	500,000	5.048,41
Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.01.2023 - 31.12.2023	0,000	0,00
Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.01.2023 - 31.12.2023	0,000	0,00
Κέρδη Χρήσεως 01.01.2023 - 31.12.2023		<u>113,51</u>
Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 31.12.2023 ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Institutional	500,000	5.161,92
ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Classic D		
Μερίδια σε κυκλοφορία την 31.12.2022	1.046.681,148	10.477.918,17
Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.01.2023 - 31.12.2023	3.588.210,874	37.776.111,09
Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.01.2023 - 31.12.2023	-1.184.398,761	-12.475.696,71
Κέρδη Χρήσεως 01.01.2023 - 31.12.2023		<u>772.071,58</u>
Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 31.12.2023 ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Classic D	3.450.493,261	36.550.404,13
Συνολική Αξία Καθαρού Ενεργητικού σε αξίες κτήσεως την 31.12.2023		63.482.181,08
II. ΔΙΑΦΟΡΕΣ ΑΠΟΤΙΜΗΣΗΣ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ		
α. Από Κινητές Αξίες / Μέσα Χρηματαγοράς		
Σε τιμές κτήσεως την 31.12.2023	60.795.157,88	
Σε τρέχουσες τιμές την 31.12.2023	<u>62.679.487,53</u>	
<u>Σύνολο Υπεραξίας / Υποαξίας</u>		1.884.329,65
β. Από Λοιπά Στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού		
Σε τιμές κτήσεως την 31.12.2023	2.687.023,20	
Σε τρέχουσες τιμές την 31.12.2023	<u>2.682.624,70</u>	
<u>Σύνολο από λοιπά στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού</u>		<u>-4.398,50</u>
Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας) & Λοιπών Στοιχείων Ενεργητικού / Παθητικού		1.879.931,15
ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12.2023		65.362.112,23

ΠΙΝΑΚΑΣ ΔΙΑΘΕΣΗΣ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΧΡΗΣΕΩΣ 01.01.2023 - 31.12.2023

Καθαρά αποτελέσματα Κέρδη χρήσεως	1.340.947,83
Κέρδη σε Κεφάλαιο	<u>1.340.947,83</u>

ΣΥΓΚΡΙΤΙΚΟΣ ΠΙΝΑΚΑΣ ΤΩΝ ΤΡΙΩΝ ΤΕΛΕΥΤΑΙΩΝ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΙΚΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ

	ΧΡΗΣΗ 2023	ΧΡΗΣΗ 2022	ΧΡΗΣΗ 2021
ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Classic			
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12	27.723.326,22	9.443.230,83	0,00
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12	2.541.878,2260	947.915,283	0,000
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12	10,9066	9,9621	0,0000
ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Institutional			
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12	5.533,04	5.015,83	0,00
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12	500,0000	500,000	0,000
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12	11,0661	10,0317	0,0000
ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ Classic D			
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12	37.633.252,97	10.427.149,56	0,00
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12	3.450.493,2610	1.046.681,148	0,000
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12	10,9066	9,9621	0,0000

ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΕΣ ΣΧΕΤΙΚΑ ΜΕ ΤΙΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΣΕ ΟΜΙΛΟΥΣ ΕΤΑΙΡΕΙΩΝ (Αρ.61, παρ.8 Ν.4099/2012)

Τα ποσοστά Επένδυσης του Αμοιβαίου σε Ομίλους Εταιρειών, κατά την 31.12.2023, ήταν εντός του νόμιμου 20% του Καθαρού Ενεργητικού.

Κατά την 31.12.2023 οι επενδύσεις σε κινητές αξίες και μέσα χρηματαγοράς εταιρειών του ίδιου ομίλου αναλύονται ως εξής:

ΟΜΙΛΟΣ/ΕΤΑΙΡΕΙΑ	ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ %
- CITIBANK	11.987,55	0,02
-- Cash	11.987,55	0,02
- National Bank of Greece SA	3.696.760,09	5,66
-- Bonds	3.696.760,09	5,66
- Alpha Services and Holdings SA	8.101.616,66	12,4
-- Bonds	5.892.840,17	9,02
-- Cash	2.208.776,49	3,38
- HELLENIC BANK PCL	2.742.278,82	4,2
-- Bonds	2.742.278,82	4,2
- PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA	5.998.630,77	9,18
-- Bonds	5.998.630,77	9,18
- HSBC BANK PLC (ΠΑΝΤΕΛΑΚΗΣ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑΚΗ Α.Ε.Π.Ε.Υ.)	370.064,72	0,57
-- Cash	370.064,72	0,57
- Aegean Airlines SA	486.639,40	0,74
-- Bonds	486.639,40	0,74
- OPAP SA	3.381.261,67	5,17
-- Equity	3.381.261,67	5,17
- Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	831.600,00	1,27
-- Equity	831.600,00	1,27
- Titan Cement Co SA	1.571.075,87	2,41
-- Equity	1.175.031,00	1,8
-- Bonds	396.044,87	0,61
- Viohalco SA	51.478,44	0,08
-- Bonds	51.478,44	0,08
- FRANCE (GOVT OF)	9.735.272,00	14,89
-- Bonds	9.735.272,00	14,89
- Ellaktor SA	446.250,00	0,68
-- Equity	446.250,00	0,68
- GEK Terna Holding Real Estate Constructi	3.523.809,44	5,39
-- Equity	2.480.400,00	3,79
-- Bonds	1.043.409,44	1,6
- Mytilineos Holdings SA	2.069.625,00	3,16
-- Equity	1.688.200,00	2,58
-- Bonds	381.425,00	0,58
- JUMBO SA	708.384,00	1,08
-- Equity	708.384,00	1,08
- Hellenic Telecommunications Organization	1.032.000,00	1,58
-- Equity	1.032.000,00	1,58
- Quest Holdings SA	393.400,00	0,6
-- Equity	393.400,00	0,6
- Public Power Corp SA	1.465.576,32	2,24
-- Bonds	1.465.576,32	2,24
- NETHERLANDS GOVERNMENT	2.783.928,00	4,26
-- Bonds	2.783.928,00	4,26
- SAFE BULKERS INC	190.143,61	0,29
-- Bonds	190.143,61	0,29
- MOTOR OIL FINANCE PLC	525.817,88	0,8
-- Bonds	525.817,88	0,8
- INTRALOT CAPITAL LUX	129.558,07	0,2
-- Bonds	129.558,07	0,2
- Costamare Inc	190.525,00	0,29
-- Bonds	190.525,00	0,29
- ATTICA ENTERPRISE HOLDIN	702.111,67	1,07
-- Bonds	702.111,67	1,07
- Hellenic Petroleum SA	780.146,71	1,19
-- Bonds	780.146,71	1,19
- Main Stream SA	1.830.096,00	2,8
-- Equity	1.830.096,00	2,8
- Consolidated Lamda Holdings SA	379.195,56	0,58
-- Bonds	379.195,56	0,58
- EUROBANK HOLDINGS	4.724.428,07	7,23
-- Bonds	4.724.428,07	7,23
- Castlflake Opportunities Partn	692.493,58	1,06
-- Bonds	692.493,58	1,06

- BANK OF CYPRUS PCL	2.298.468,47	3,45
-- Bonds	2.298.468,47	3,45
- FRIGO DEBTCO PLC	172.528,91	0,26
-- Equity	0,60	0
-- Bonds	172.528,31	0,26
- BANK OF CYPRUS HOLDINGS PLC	2.275.092,76	3,48
-- Bonds	2.275.092,76	3,48
- Trade Estates Real Estate Inve	1.760.000,00	2,69
-- Equity	1.760.000,00	2,69

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (31.12.2023)

Εκδότης / Χώρα Έκδοσης / Ημ. Έκδοσης	Isin	Ανάκληση (Callability)	Πηγή Τιμολ.	Composite
Ομόλογα Σταθερού Επιτοκίου				
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 19/02/2020	XS2121408996	OXI	BGN	B-
Aegean Airlines SA / GR / 12/03/2019	GRC4951193D4	OXI	EXCH	NR
BANK OF CYPRUS HOLDINGS PLC / IE / 16/04/2021	XS2333239692	OXI	BGN	B
BANK OF CYPRUS PCL / CY / 18/07/2023	XS2648493570	OXI	BGN	BB
SAFE BULKERS INC / CY / 11/02/2022	GRC8261222B1	OXI	EXCH	NR
MOTOR OIL FINANCE PLC / GR / 19/07/2021	XS2364001151	OXI	BGN	NR
LAMDA Development SA / GR / 21/07/2020	GRC2451207D1	OXI	EXCH	NR
HELLENIC BANK PCL / CY / 15/07/2022	XS2498640056	OXI	BGN	BB
Public Power Corp SA / GR / 18/03/2021	XS2314265237	OXI	BGN	BB-
TITAN GLOBAL FINANCE PLC / GB / 09/07/2020	XS2199268470	OXI	BGN	BB
National Bank of Greece SA / GR / 18/07/2019	XS2028846363	OXI	BGN	B+
Mytilineos Holdings SA / GR / 28/04/2021	XS2337604479	OXI	BGN	BB
Costamare Inc / CY / 25/05/2021	GRC5211214B5	OXI	EXCH	NR
Public Power Corp SA / GR / 21/07/2021	XS2359929812	OXI	BGN	BB-
PRODEA REAL ESTATE INV / GR / 20/07/2021	GRC5091217D9	OXI	EXCH	NR
ELVALHALCOR HELLENIC COPPER & ALLUM.S.A / GR / 16/11/2021	GRC281121BD8	OXI	EXCH	NR
GEK Terma Holding Real Estate Constructi / GR / 04/04/2018	GRC1451184D4	OXI	EXCH	NR
INTRALOT CAPITAL LUX / LU / 20/09/2017	XS1685702794	OXI	BGN	CCC
HELLENIC PETROLEUM FINAN / GB / 04/10/2019	XS2060691719	OXI	BGN	NR
Alpha Services and Holdings SA / GR / 13/02/2020	XS2111230285	OXI	BGN	B-
ATTICA ENTERPRISE HOLDIN / GR / 26/07/2019	GRC1441197B3	OXI	EXCH	NR
Alpha Services and Holdings SA / GR / 11/03/2021	XS2307437629	OXI	BGN	B-
TERNA ENERGY FINANCE / GR / 22/10/2019	GRC813119AD1	OXI	EXCH	NR
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 03/11/2021	XS2400040460	OXI	BGN	BB-
EUROBANK HOLDINGS / GR / 29/11/2022	XS2562543442	OXI	BGN	B+
FRIGO DEBTCO PLC / GB / 17/04/2023	XS2603999264	OXI	BVAL	NR
BANK OF CYPRUS PCL / CY / 16/06/2021	XS2355059168	OXI	BGN	BB
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 09/06/2021	XS2354777265	OXI	BGN	CCC+
Alpha Services and Holdings SA / GR / 01/02/2023	XS2583633966	OXI	BGN	B
HELLENIC BANK PCL / CY / 07/03/2023	XS2597995112	OXI	BGN	BB-
National Bank of Greece SA / GR / 26/09/2023	XS2595343059	OXI	BGN	BB
Ομόλογα Zero Coupon				
FRANCE (GOVT OF) / FR / 30/01/2023	FR0127613497	OXI	BGN	AA
FRANCE (GOVT OF) / FR / 24/04/2023	FR0127921064	OXI	BGN	AA
NETHERLANDS GOVERNMENT / NL / 04/09/2023	NL0015001MS4	OXI	BGN	AAA

ΛΟΙΠΕΣ ΓΝΩΣΤΟΠΟΙΗΣΕΙΣ

ΜΕΘΟΔΟΣ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ ΣΥΝΟΛΙΚΗΣ ΕΚΘΕΣΗΣ ΣΕ ΚΙΝΔΥΝΟ

ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΑΝΑΦΟΡΑΣ

MAX VAR 2023

MIN VAR 2023

AVERAGE VAR 2023

ΕΠΙΠΕΔΟ ΜΟΧΛΕΥΣΗΣ 2023 (μέσος όρος έτους)

ΑΠΟΛΥΤΗ ΑΞΙΑ ΣΕ ΚΙΝΔΥΝΟ

Δ/Υ

5,8%

2,8%

3,8%

1,6%

I. ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗ ΘΕΣΗ (ΙΣΟΛΟΓΙΣΜΟΣ) της 31.12.2023
(N.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.11 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

	<u>31.12.2023</u>	<u>31.12.2022</u>	<u>31.12.2021</u>
Μεταβιβάσιμοι Τίτλοι	62.679.487,53	17.046.515,88	0,00
Καταθέσεις σε τράπεζες	2.220.764,04	3.353.894,81	0,00
Λοιπά περιουσιακά στοιχεία	<u>1.151.993,47</u>	<u>163.915,70</u>	<u>0,00</u>
Σύνολο περιουσιακών στοιχείων	66.052.245,04	20.564.326,39	0,00
Υποχρεώσεις	<u>-690.132,81</u>	<u>-688.930,17</u>	0,00
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων	65.362.112,23	19.875.396,22	0,00
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Subfund	5.992.871,49	1.995.096,431	-
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	-	-	-
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Classic	2.541.878,226	947.915,283	0,000
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	10,9066	9,9621	0,0000
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Institutional	500,000	500,000	0,000
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	11,0661	10,0317	0,0000
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Classic D	3.450.493,261	1.046.681,148	0,000
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	10,9066	9,9621	0,0000
Ανάλυση Χαρτοφυλακίου			
1. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε επίσημο χρηματιστήριο αξιών	19.233.052,27	3.148.885,37	0,00
2. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε άλλες ρυθμιζόμενες αγορές	43.446.434,66	13.897.630,51	0,00
3. Προσφάτως εκδοθέντες μεταβιβάσιμοι τίτλοι η έκδοση των οποίων περιέχει όρους για εισαγωγή εντός έτους σε επίσημο χρηματιστήριο ή άλλη ρυθμιζόμενη αγορά	0,00	0,00	0,00
4. Λοιποί μεταβιβάσιμοι τίτλοι που δεν περιλαμβάνονται στις περιπτώσεις (1), (2) και (3)	0,00	0,00	0,00
5. Μη Μεταβιβάσιμοι τίτλοι	<u>0,60</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>
Σύνολο	62.679.487,53	17.046.515,88	0,00

II. ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΞΕΛΙΞΗΣ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΩΝ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ Χρήσεως 01.01.2023 έως 31.12.2023
(N.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.12 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

	<u>01.01.-31.12.23</u>	<u>01.01.-31.12.22</u>	<u>01.01.-31.12.21</u>
A. Κατάσταση Αποτελεσμάτων χρήσεως			
Εισόδημα από επενδύσεις	1.886.693,16	413.593,51	0,00
Κέρδη / (Ζημιές) από αγοραπωλησίες κινητών αξιών / μέσων χρηματαγοράς	344.682,22	57.391,81	0,00
Λοιπά εισοδήματα	-1.027,19	51,67	0,00
Έξοδα διαχείρισης	-608.724,45	-234.549,83	0,00
Έξοδα θεματοφύλακα	-28.409,03	-10.947,24	0,00
Λοιπά έξοδα και φόροι	<u>-252.266,88</u>	<u>-33.702,25</u>	<u>0,00</u>
Καθαρό εισόδημα	1.340.947,83	191.837,67	0,00
B. Κατάσταση λοιπών μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων αποτελεσμάτων χρήσεως			
Έκδοση νέων μεριδίων	64.724.973,10	30.260.204,08	0,00
Εξαγορές μεριδίων	-22.606.261,62	-10.429.519,98	0,00
Διαφορές επιμέτρησης επενδύσεων	<u>2.027.056,70</u>	<u>-147.125,55</u>	<u>0,00</u>
Σύνολο	44.145.768,18	19.683.558,55	0,00
Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B)	45.486.716,01	19.875.396,22	0,00

ΣΗΜΕΙΩΣΕΙΣ

- Η σύνταξη της Κατάστασης Χρηματοοικονομικής Θέσης (Ισολογισμός) και η Κατάσταση Εξέλιξης των Καθαρών Περιουσιακών Στοιχείων χρήσεως πραγματοποιήθηκε κατά την κρίση της Διοίκησης της Διαχειρίστριας Εταιρείας, λαμβάνοντας υπόψη τα υποδείγματα του Ν.4308/2014 (Παράρτημα Β) και τις σχετικές αποφάσεις των αρμόδιων αρχών.
- Η αποτίμηση των Treasury-Bills εξωτερικού έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των δημοσιευμένων τιμών κλεισίματος Bloomberg (όπως ορίζεται στην πηγή τιμολόγησης στον Πίνακα Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων) της 29.12.2023 (καθώς η 31.12.2023 ήταν αργία). Η τρέχουσα αξία ορίζεται ως το γινόμενο της ονομαστικής αξίας επί τρέχουσα τιμή /100.
- Η αποτίμηση των ομολόγων εσωτερικού και εξωτερικού έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των δημοσιευμένων τιμών κλεισίματος Bloomberg (όπως ορίζεται στην πηγή τιμολόγησης στον Πίνακα Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων) της 29.12.2023 (καθώς η 31.12.2023 ήταν αργία). Η τρέχουσα αξία ορίζεται ως το γινόμενο της ονομαστικής αξίας επί τρέχουσα τιμή /100.
- Η αποτίμηση των μετοχών εταιρειών εσωτερικού και εξωτερικού εισηγμένων σε ενεργό αγορά, έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των τιμών κλεισίματος της 29.12.2023 (καθώς η 31.12.2023 ήταν αργία).
- Η μη εισηγμένη σε ενεργό αγορά εξωτερικού μετοχή FRIGO DEBTCO αποτιμήθηκε σε αξία μνείας 0,001, λαμβάνοντας υπόψη τις πρόνοιες της απόφασης της Ε.Κ.13/350/31.08.2005 και του γεγονότος ότι πρόκειται για νεοϊδρυθείσα εταιρεία (06.03.2023), η οποία προήλθε από τη διάσπαση της αρχικής εταιρείας (λόγω αναδιάρθρωσης ομολογιακού δανείου) και για την οποία δεν υπάρχουν δημοσιευμένες οικονομικές καταστάσεις.
- Η αποτίμηση των παραγώγων χρηματοοικονομικών προϊόντων που είναι εισηγμένα σε Χρηματιστήρια Παραγώγων εσωτερικού - εξωτερικού, έγινε καθ'όλη τη διάρκεια της χρήσεως 01.01.2023 - 31.12.2023 στις εκάστοτε τιμές διακανονισμού (κλείσιμο) και τα προκύψαντα κέρδη ή ζημιές έχουν λογισθεί στα Αποτελέσματα Χρήσεως.
- Οι Δεδουλευμένοι Τόκοι των Ομολογιακών Δανείων (μείον οι τόκοι που καταβλήθηκαν για την αγορά τους) περιλαμβάνονται στα έσοδα της χρήσεως 01.01.2023 - 31.12.2023 και απεικονίζονται στους μεταβατικούς λογαριασμούς του Ενεργητικού.
- Οι καταθέσεις όψεως που περιλαμβάνονται στην κατηγορία Καταθέσεις σε Πιστωτικά Ιδρύματα αποτιμήθηκαν στην λογιστική τους αξία κατά την 31.12.2023, η οποία δε διαφέρει από την εύλογη αξία τους. Οι δεδουλευμένοι τόκοι των καταθέσεων όψεως έως και την 31.12.2023, περιλαμβάνονται στα έσοδα της χρήσεως 01.01.2023 - 31.12.2023.
- Ως πιστοληπτική διαβάθμιση των Treasury-Bills εξωτερικού και των ομολόγων εσωτερικού και εξωτερικού, λήφθηκε η σύνθεση (composite) των δεικτών των οίκων αξιολόγησης S&P, MOODY'S και FITCH, όπως αυτή δημοσιεύεται στη διεθνώς αναγνωρισμένη πηγή πληροφόρησης Bloomberg. Όπου δεν υπάρχει σύνθεση δεικτών ως πιστοληπτική διαβάθμιση λήφθηκε κατά σειρά αυτή των οίκων αξιολόγησης S&P, MOODY'S και FITCH, με ανάλογη προσαρμογή σε μορφή σύνθεσης (composite) Bloomberg.
- Η μετατροπή των ξένων νομισμάτων σε EUR έγινε με βάση το δελτίο συναλλαγματικών ισοτιμιών αναφοράς BGN-BID (ώρα κλεισίματος Χρηματιστηρίου Νέας Υόρκης) της 29.12.2023 (καθώς η 31.12.2023 ήταν αργία).

11. Στην διάρκεια της χρήσεως από 01.01.2023 έως 31.12.2023, η εταιρεία διαχειρίσεως συμμετείχε με τηλεδιάσκεψη εξ αποστάσεως στις Γενικές Συνελεύσεις των περισσότερων από τις εκδότριες εταιρείες των μετοχών του χαρτοφυλακίου του Α/Κ και άσκησε τα δικαιώματα ψήφου.

12. Στον πίνακα προέλευσης καθαρού ενεργητικού και αποτελεσμάτων από 01.01.2023 - 31.12.2023 η αξία των μεριδίων 31.12.2022 εμφανίζεται σε κόστος κτήσεως.

13. Τα επί του Καθαρού Ενεργητικού του Αμοιβαίου Κεφαλαίου ποσοστά επενδύσεων σε ομίλους εταιρειών, δεν υπερβαίνουν τα επιτρεπόμενα επενδυτικά όρια σύμφωνα με τις διατάξεις των άρθρων 61 έως 65 του Ν.4099/2012.

14. Η κατηγοριοποίηση της αξίας των χρηματοοικονομικών στοιχείων του ενεργητικού του αμοιβαίου κεφαλαίου έχει ως εξής:

	Κατηγορία 1	Κατηγορία 2	Κατηγορία 3	Σύνολο
Μετοχές	15.726.622,67	-	0,60	15.726.623,27
Ομολογίες	34.433.664,26	-	-	34.433.664,26
Μέσα Χρηματαγοράς	12.519.200,00	-	-	12.519.200,00
Σύνολο	62.679.486,93	-	0,60	62.679.487,53

Κατηγορία 1: Στην κατηγορία αυτή περιλαμβάνονται τα χρηματοοικονομικά στοιχεία που επιμετρήθηκαν βάσει δημοσιευμένων τιμών.

Κατηγορία 2: Στην κατηγορία αυτή περιλαμβάνονται τα χρηματοοικονομικά στοιχεία που επιμετρήθηκαν βάσει τεχνικών επιμέτρησης με χρήση δεδομένων που έχουν παρατηρήσιμες τιμές στην αγορά.

Κατηγορία 3: Στην κατηγορία αυτή περιλαμβάνονται τα χρηματοοικονομικά στοιχεία που επιμετρήθηκαν βάσει τεχνικών επιμέτρησης με χρήση δεδομένων που δεν έχουν παρατηρήσιμες τιμές στην αγορά.

15. Έκθεση δραστηριότητας Ν.4099/ άρθρο 77.

Το 2023, το Α/Κ κατέγραψε απόδοση +9,47%. Κατά τη διάρκεια του έτους αυξήσαμε την έκθεση σε ελληνικά εταιρικά ομόλογα και ελληνικές μετοχές υψηλής μερισματικής απόδοσης μειώνοντας αντίστοιχα την έκθεση σε μετρητά. Η έκθεση σε ελληνικές μετοχές υψηλής μερισματικής απόδοσης στο τέλος του έτους ήταν 24,1%. Οι κυριότερες κλαδικές επενδύσεις του Α/Κ στο τέλος του έτους ήταν σε ομόλογα του χρηματοπιστωτικού κλάδου. Το μετοχικό χαρτοφυλάκιο επικεντρώθηκε σε ελληνικές μετοχές υψηλής μερισματικής απόδοσης. Η αναβάθμιση της πιστοληπτικής ικανότητας του Ελληνικού Δημοσίου και η ανάκτηση της επενδυτικής βαθμίδας από τους διεθνείς οίκους αξιολόγησης βοήθησε στη μείωση των επιτοκίων δανεισμού της Ελλάδας και κατ' επέκταση των ελληνικών επιχειρήσεων, ενώ παρείχε σημαντική στήριξη στις τιμές των ελληνικών εταιρικών ομολόγων και μετοχών. Κατά τη διάρκεια του έτους, αυξήσαμε την έκθεση σε ομόλογα χαμηλότερης εξασφάλισης των ελληνικών συστημικών τραπεζών (Lower Tier 2) και μειώσαμε την έκθεση σε ομόλογα κύριας εξασφάλισης (senior). Οι κύριες επενδύσεις του Α/Κ σε ομόλογα στο τέλος του έτους ήταν σε ομόλογα της Eurobank, Τράπεζας Πειραιώς και της Alpha Bank ενώ σε μετοχές ήταν στις ΟΠΑΠ, Τέρνα Ενεργειακή, Autohellas και Μυτιληναίος.

16. Σύμφωνα με το Αρθ.1, παρ.11 Αποφ.Επ. Κεφ.18/775/31.1.2017, παρουσιάζεται το συνολικό ύψος των ετήσιων ακαθάριστων αποδοχών (σταθερών και μεταβλητών) για το οικονομικό έτος 2023 που κατέβαλε η εταιρεία διαχείρισης Alpha Asset Management Α.Ε.Δ.Α.Κ. στο προσωπικό, το οποίο ανήλθε στα 2.762.005,18 € και ο συνολικός αριθμός των δικαιούχων ανήλθε σε 48 (συμπερ.αποχωρήσεων).

Ακολουθεί ανάλυση των συνολικών αποδοχών ανά κατηγορία προσωπικού:

Κατηγορία Προσωπικού	Ετήσιες σταθερές αποδοχές	Ετήσιες μεταβλητές αποδοχές
Εκτελεστικά Μέλη Διοικητικού Συμβουλίου (MRTs)	450.167,51	52.340,00
Μη Εκτελεστικά Μέλη Διοικητικού Συμβουλίου	77.358,36	-
Πρόσωπα που ασκούν καθήκοντα ελέγχου (MRTs)	126.393,69	12.520,00
Άλλα πρόσωπα που αναλαμβάνουν κινδύνους	838.672,60	81.550,00
Υποστηρικτικές λειτουργίες	1.072.723,02	50.280,00
	2.565.315,18	196.690,00

Η Πολιτική Αποδοχών καθορίζει το πλαίσιο αποδοχών της Εταιρείας και εφαρμόζεται σε όλο το Προσωπικό με σύμβαση εξαρτημένης εργασίας. Η Πολιτική είναι ευθυγραμμισμένη με την Πολιτική Αποδοχών της Alpha Bank Α.Ε. και των άλλων εταιρειών του Τραπεζικού Ομίλου, ώστε να διασφαλίζεται η συνέπεια σε εννοποιημένη βάση.

Οι λεπτομέρειες της επικαιροποιημένης Πολιτικής Αποδοχών, όπου περιλαμβάνεται, μεταξύ άλλων, περιγραφή του τρόπου με τον οποίο υπολογίζονται οι αποδοχές και παροχές, καθώς και η ταυτότητα των προσώπων που είναι υπεύθυνα για την υιοθέτηση και εφαρμογή της Πολιτικής Αποδοχών, είναι διαθέσιμες μέσω της ιστοσελίδας της Εταιρείας πατώντας **εδώ**.

Αθήνα, 26.04.2024

Ο Θεματοφύλακας
ALPHA BANK

Η Εταιρεία Διαχειρίσεως
ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

A.N. ΑΡΟΤΣΙΔΟΥ

E.A. ΓΡΥΠΑΙΟΥ

Π.Δ. ΑΝΤΩΝΟΠΟΥΛΟΣ

Π.Δ. ΜΠΛΕΤΣΑ
Αρ. Αδείας Ο.Ε.Ε. Α' Τάξεως 114762

Έκθεση Ανεξάρτητου Ορκωτού Ελεγκτή Λογιστή

Προς τη Διοίκηση της “ΑΛΦΑ ASSET MANAGEMENT ΜΟΝΟΠΡΟΣΩΠΗ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΕΩΣ ΑΜΟΙΒΑΙΩΝ ΚΕΦΑΛΑΙΩΝ” για λογαριασμό των μεριδιούχων του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ”

Έκθεση Ελέγχου επί της Ετήσιας Έκθεσης Διαχείρισεως του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ”

Γνώμη

Έχουμε ελέγξει την Ετήσια Έκθεση Διαχείρισεως της χρήσεως που έληξε την 31^η Δεκεμβρίου 2023 (από 1.1. έως 31.12.2023) του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ” (η Έκθεση Διαχείρισεως), που καταρτίστηκε από την διαχειριζόμενη την περιουσία του “ΑΛΦΑ ASSET MANAGEMENT ΜΟΝΟΠΡΟΣΩΠΗ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΕΩΣ ΑΜΟΙΒΑΙΩΝ ΚΕΦΑΛΑΙΩΝ” (η Διαχειρίστρια Εταιρεία) η οποία περιλαμβάνει τον Ισολογισμό, την κατάσταση εξέλιξης των καθαρών περιουσιακών στοιχείων της χρήσεως, καθώς και τις λοιπές πληροφορίες, τα στοιχεία και τις επεξηγηματικές σημειώσεις του Αμοιβαίου Κεφαλαίου.

Κατά τη γνώμη μας, η ανωτέρω Έκθεση Διαχείρισεως παρουσιάζει εύλογα από κάθε ουσιώδη άποψη, την χρηματοοικονομική θέση του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA ΣΥΝΤΗΡΗΤΙΚΟ ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΜΙΚΤΟ” κατά την 31^η Δεκεμβρίου 2023 και την χρηματοοικονομική του επίδοση για τη χρήση που έληξε την ημερομηνία αυτή, σύμφωνα με τις σχετικές διατάξεις του Ν. 4308/2014, περιλαμβάνοντας τις πληροφορίες, τα στοιχεία και τις επεξηγηματικές σημειώσεις που προβλέπονται από το άρθρο 77 του Ν. 4099/2012 και το άρθρο 4 της απόφασης 17/633/20.12.2012 του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς, όπως ισχύουν.

Βάση γνώμης

Διενεργήσαμε τον έλεγχο μας σύμφωνα με τα Διεθνή Πρότυπα Ελέγχου (ΔΠΕ), όπως αυτά έχουν ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία. Οι ευθύνες μας, σύμφωνα με τα πρότυπα αυτά περιγράφονται περαιτέρω στην παράγραφο της έκθεσής μας “Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισεως”.

Είμαστε ανεξάρτητοι από την Διαχειρίστρια Εταιρεία, καθ’ όλη τη διάρκεια του διορισμού μας, σύμφωνα με τον Κώδικα Δεοντολογίας για Επαγγελματίες Ελεγκτές του Συμβουλίου Διεθνών Προτύπων Δεοντολογίας Ελεγκτών, όπως αυτός έχει ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία και τις απαιτήσεις δεοντολογίας που σχετίζονται με τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισεως στην Ελλάδα και έχουμε εκπληρώσει τις δεοντολογικές μας υποχρεώσεις σύμφωνα με τις απαιτήσεις της ισχύουσας νομοθεσίας και του προαναφερόμενου Κώδικα Δεοντολογίας. Πιστεύουμε ότι τα ελεγκτικά τεκμήρια που έχουμε αποκτήσει είναι επαρκή και κατάλληλα να παρέχουν βάση για τη γνώμη μας.

Έμφαση θέματος

Εφιστούμε την προσοχή σας στη σημείωση 1 της Έκθεσης Διαχείρισεως όπου γίνεται αναφορά στο πλαίσιο κατάρτισής της σύμφωνα με τις υφιστάμενες κανονιστικές διατάξεις.

Στη γνώμη μας δεν διατυπώνεται επιφύλαξη σε σχέση με το θέμα αυτό.

Ευθύνες της διοίκησης της Διαχειρίστριας Εταιρείας για την Έκθεση Διαχείρισεως

Η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας έχει την ευθύνη για την κατάρτιση και εύλογη παρουσίαση της Έκθεσης Διαχείρισεως, σύμφωνα με τις σχετικές διατάξεις του Ν. 4308/2014 και του Ν. 4099/2012 καθώς και της απόφασης 17/633/20.12.2012 του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς, όπως ισχύουν και για εκείνες τις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου, που η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας καθορίζει ως απαραίτητες, ώστε να καθίσταται δυνατή η κατάρτιση Έκθεσης Διαχείρισεως, απαλλαγμένης από ουσιώδες σφάλμα, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος.

Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχειρίσεως

Οι στόχοι μας είναι να αποκτήσουμε εύλογη διασφάλιση για το κατά πόσο η Έκθεση Διαχειρίσεως στο σύνολό της είναι απαλλαγμένη από ουσιώδες σφάλμα, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος και να εκδώσουμε έκθεση ελεγκτή, η οποία περιλαμβάνει τη γνώμη μας. Η εύλογη διασφάλιση συνιστά διασφάλιση υψηλού επιπέδου, αλλά δεν είναι εγγύηση ότι ο έλεγχος που διενεργείται σύμφωνα με τα ΔΠΕ, όπως αυτά έχουν ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία, θα εντοπίζει πάντα ένα ουσιώδες σφάλμα, όταν αυτό υπάρχει. Σφάλματα δύναται να προκύψουν από απάτη ή από λάθος και θεωρούνται ουσιώδη όταν, μεμονωμένα ή αθροιστικά, θα μπορούσε εύλογα να αναμένεται ότι θα επηρέαζαν τις οικονομικές αποφάσεις των χρηστών, που λαμβάνονται με βάση αυτή την Έκθεση Διαχειρίσεως.

Ως καθήκον του ελέγχου, σύμφωνα με τα ΔΠΕ όπως αυτά έχουν ενσωματωθεί στην Ελληνική Νομοθεσία, ασκούμε επαγγελματική κρίση και διατηρούμε επαγγελματικό σκεπτικισμό καθ' όλη τη διάρκεια του ελέγχου. Επίσης:

- Εντοπίζουμε και αξιολογούμε τους κινδύνους ουσιώδους σφάλματος στην Έκθεση Διαχειρίσεως, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος, σχεδιάζοντας και διενεργώντας ελεγκτικές διαδικασίες που ανταποκρίνονται στους κινδύνους αυτούς και αποκτούμε ελεγκτικά τεκμήρια που είναι επαρκή και κατάλληλα για να παρέχουν βάση για τη γνώμη μας. Ο κίνδυνος μη εντοπισμού ουσιώδους σφάλματος που οφείλεται σε απάτη είναι υψηλότερος από αυτόν που οφείλεται σε λάθος, καθώς η απάτη μπορεί να εμπεριέχει συμπαιγνία, πλαστογραφία, εσκεμμένες παραλείψεις, ψευδείς διαβεβαιώσεις ή παράκαμψη των δικλίδων εσωτερικού ελέγχου.
- Κατανοούμε τις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου που σχετίζονται με τον έλεγχο, με σκοπό το σχεδιασμό ελεγκτικών διαδικασιών κατάλληλων για τις περιστάσεις, αλλά όχι με σκοπό την διατύπωση γνώμης επί της αποτελεσματικότητας των δικλίδων εσωτερικού ελέγχου της Διαχειρίστριας Εταιρείας.
- Αξιολογούμε την καταλληλότητα των λογιστικών πολιτικών και μεθόδων που χρησιμοποιήθηκαν και το εύλογο των λογιστικών εκτιμήσεων και των σχετικών γνωστοποιήσεων που έγιναν από τη διοίκηση.
- Αξιολογούμε τη συνολική παρουσίαση, τη δομή και το περιεχόμενο της Έκθεσης Διαχειρίσεως, συμπεριλαμβανομένων των γνωστοποιήσεων, καθώς και το κατά πόσο η Έκθεση Διαχειρίσεως απεικονίζει τις υποκείμενες συναλλαγές και τα γεγονότα με τρόπο που επιτυγχάνεται η εύλογη παρουσίαση.

Μεταξύ άλλων θεμάτων, κοινοποιούμε στη διοίκηση, το σχεδιαζόμενο εύρος και το χρονοδιάγραμμα του ελέγχου, καθώς και σημαντικά ευρήματα του ελέγχου, συμπεριλαμβανομένων όποιων σημαντικών ελλείψεων στις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου εντοπίζουμε κατά τη διάρκεια του ελέγχου μας.

Αθήνα, 29 Απριλίου 2024

Ο Ορκωτός Ελεγκτής Λογιστής

Θεόδωρος Κ. Τσιούλας

A.M. ΣΟΕΛ: 41061

Deloitte Ανώνυμη Εταιρία Ορκωτών Ελεγκτών Λογιστών

Φραγκοκκλησιάς 3α & Γρανικού, 151 25 Μαρούσι

A.M. ΣΟΕΛ: E 120



This document has been prepared by Deloitte Certified Public Accountants Societe Anonyme.

Deloitte Certified Public Accountants Societe Anonyme, a Greek company, registered in Greece with registered number 0001223601000 and its registered office at Marousi, Attica, 3a Fragkokklisias & Granikou str., 151 25, is one of the Deloitte Central Mediterranean S.r.l. ("DCM") countries. DCM, a company limited by guarantee registered in Italy with registered number 09599600963 and its registered office at Via Tortona no. 25, 20144, Milan, Italy is one of the Deloitte NSE LLP geographies. Deloitte NSE LLP is a UK limited liability partnership and member firm of DTTL, a UK private company limited by guarantee.

DTTL and each of its member firms are legally separate and independent entities. DTTL, Deloitte NSE LLP and Deloitte Central Mediterranean S.r.l. do not provide services to clients. Please see www.deloitte.com/about to learn more about our global network of member firms.