



ALPHA ΑΜΟΙΒΑΙΑ ΚΕΦΑΛΑΙΑ

ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ: ALPHA BANK Α.Ε.

ΕΚΘΕΣΗ ΠΕΡΙΟΔΟΥ ΙΑΝΟΥΑΡΙΟΥ - ΙΟΥΝΙΟΥ 2024

**ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ
ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ**

ΑΥΓΟΥΣΤΟΣ 2024

ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ
 ΑΠΟΦΑΣΗ Ε.Κ. 499/07.12.2023
 ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ: ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ. (ΑΡ.Γ.Ε.ΜΗ. 920101000)
 ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ ALPHA BANK Α.Ε.
 ΕΞΑΜΗΝΙΑΙΑ ΕΚΘΕΣΗ 2024 (Περίοδος 01.01.2024 - 30.06.2024)
 (Αρ. 77 Ν.4099/12 - Φ.Ε.Κ. 250/Α/ 20.12.2012, Ν.4308/2014)

ΕΙΔΟΣ ΔΕΙΟΓΡΑΦΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ / ΟΝΟΜΑΣΤΙΚΗ ΑΞΙΑ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΤΙΜΗ ΜΟΝΑΔΟΣ ΣΕ ΝΟΜΙΣΜΑ ΑΝΑΦΟΡΑΣ	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ Ξ.Ν	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ ΤΟΥ ΣΥΝΟΛΟΥ ΤΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ	ΠΟΣΟΣΤΟ ΕΠΙ ΤΟΥ ΣΥΝΟΛΟΥ ΤΟΥ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ
ΑΝΑΛΥΤΙΚΗ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΗ ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ (Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)						
ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ						
ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ						
ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ						
ΟΜΟΛΟΓΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ ΕΤΑΙΡΙΚΑ ΣΕ EUR						
	2.950.000	95,9540		2.830.643,00	0,71 %	0,72 %
MOTOR OIL (HELLAS) SA / XS2364001151						
PUBLIC POWER CORP / XS2314265237	36.251.000	99,8470		36.195.535,97	9,12 %	9,15 %
INTESA SANPAOLO SPA / XS2081018629	100.000	93,8910		93.891,00	0,02 %	0,02 %
NATIONAL BANK GREECE SA / XS2237982769	11.200.000	97,5910		10.930.192,00	2,76 %	2,76 %
ALPHA BANK SA / XS2549772924	300.000	100,8970		302.691,00	0,08 %	0,08 %
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / XS2400040460	400.000	98,1050		392.420,00	0,10 %	0,10 %
PIRAEUS BANK SA / XS2559486019	32.700.000	106,2740		34.751.598,00	8,76 %	8,79 %
ALPHA BANK SA / XS2562213145	31.600.000	105,6040		33.370.864,00	8,41 %	8,44 %
BANK OF CYPRUS PCL / XS2355059168	36.912.000	95,9150		35.404.144,80	8,92 %	8,95 %
HSBC HOLDINGS PLC / XS2486589596	14.000.000	98,4610		13.784.540,00	3,47 %	3,49 %
CREDIT AGRICOLE SA / FR0014009UH8	12.000.000	96,5570		11.586.840,00	2,92 %	2,93 %
BANK OF AMERICA / XS2462324232	14.000.000	97,5790		13.661.060,00	3,44 %	3,45 %
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG / XS2322289385	3.000.000	94,1580		2.824.740,00	0,71 %	0,71 %
UNICREDIT SPA / XS2289133915	7.000.000	94,9190		6.644.330,00	1,67 %	1,68 %
STANDARD CHARTERED PLC / XS2021467753	11.500.000	94,4660		10.863.590,00	2,74 %	2,75 %
DEUTSCHE BANK AG / DE000DL19US6	16.100.000	98,1150		15.796.515,00	3,98 %	3,99 %
UBS GROUP AG / CH1174335732	16.900.000	97,6600		16.504.540,00	4,16 %	4,17 %
BNP PARIBAS / FR0014002X43	16.000.000	93,8440		15.015.040,00	3,78 %	3,80 %
ING GROEP NV / XS2443920249	12.000.000	96,0420		11.525.040,00	2,91 %	2,91 %
KBC GROUP NV / BE0002832138	10.000.000	94,3270		9.432.700,00	2,38 %	2,38 %
BANCO COMERC PORTUGUES / PTBPC2OM0058	15.100.000	101,8130		15.373.763,00	3,88 %	3,89 %
INTESA SANPAOLO SPA / XS2625195891	10.000.000	100,4830		10.048.300,00	2,53 %	2,54 %
JPMORGAN CHASE & CO / XS1960248919	9.000.000	95,7300		8.615.700,00	2,17 %	2,18 %
MORGAN STANLEY / XS1706111793	13.500.000	96,9910		13.093.785,00	3,30 %	3,31 %
BANCO SANTANDER SA / XS2538366878	14.000.000	99,8150		13.974.100,00	3,52 %	3,53 %
UNICAJA BANCO SA / ES0380907040	6.500.000	95,7710		6.225.115,00	1,57 %	1,57 %
MIZUHO FINANCIAL GROUP / XS2329143510	1.000.000	94,3050		943.050,00	0,24 %	0,24 %
SOCIETE GENERALE / FR0014006IU2	6.000.000	95,0830		5.704.980,00	1,44 %	1,44 %
SWEDBANK AB / XS2343563214	15.000.000	94,0100		14.101.500,00	3,55 %	3,57 %
EUROBANK SA / XS2338193019	17.300.000	95,4280		<u>16.509.044,00</u>	4,16 %	4,18 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ				<u>386.500.251,77</u>	97,40 %	97,72 %
ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ TREASURY-BILLS						
FRENCH DISCOUNT T-BILL / FR0128379429	3.000.000	99,4130		<u>2.982.390,00</u>	0,75 %	0,75 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				<u>2.982.390,00</u>	0,75 %	0,75 %
ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
				<u>389.482.641,77</u>	98,15 %	98,47 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ						
				<u>389.482.641,77</u>	98,15 %	98,47 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ						
				<u>389.482.641,77</u>	98,15 %	98,47 %
ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ						
ΜΕΤΑΒΑΤΙΚΟΙ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ				<u>4.058.992,57</u>	1,02 %	1,03 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ				<u>4.058.992,57</u>	1,02 %	1,03 %
ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ						
ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΦΕΩΣ						
ALPHA BANK EUR				1.638.178,30	0,41 %	0,41 %
CITIBANK EUR				<u>1.529.996,81</u>	0,39 %	0,39 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΦΕΩΣ				<u>3.168.175,11</u>	0,80 %	0,80 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ				<u>3.168.175,11</u>	0,80 %	0,80 %
ΣΥΝΟΛΟ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ				<u>396.709.809,45</u>	99,97 %	100,30 %

ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ		
ΠΙΣΤΩΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ		-356.817,07
ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ ΑΠΟ ΦΟΡΟΥΣ		<u>-841.474,22</u>
ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ	-1.198.291,29	-0,30 %

ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ	395.511.518,16	100,00 %
--	-----------------------	-----------------

ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ Classic D

Αξία Καθαρού Ενεργητικού Περιόδου 01.01.2024 - 30.06.2024		395.511.518,16
Αριθμός Μεριδίων σε κυκλοφορία	39.384.002,930	
Τιμή Μεριδίου	10,0424	

ΠΙΝΑΚΑΣ ΜΕΤΑΒΟΛΩΝ ΚΙΝΗΤΩΝ ΑΞΙΩΝ ΚΑΙ ΜΕΙΩΝ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ

ΜΕΤΑΞΥ 30.06.2024 ΚΑΙ 31.12.2023

(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)

		30.06.2024	31.12.2023	ΜΕΤΑΒΟΛΗ
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ		395.511.518,16	306.985,24	
ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ	98,47 %	97,52 %		0,95 %
ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ				
ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ		0,00 %	97,52 %	-97,52 %
ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ				
ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ ΑΛΛΟΔΑΠΩΝ ΔΑΝΕΙΩΝ		97,72 %	0,00 %	97,72 %
ΜΕΣΑ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ		0,75 %	0,00 %	0,75 %

ΑΝΑΛΥΤΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ

ΠΕΡΙΟΔΟΥ 01.01.2024 - 30.06.2024

A. ΠΡΟΣΟΔΟΙ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ	ΑΞΙΑ ΣΕ EUR		
I. Τόκοι Τραπεζικών Καταθέσεων	15.990,70		
II. Έσοδα Ομολογιών αλλοδαπών Δανείων	5.555.290,04		
			5.571.280,74
B. ΚΕΡΔΗ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ			
I. Κέρδη από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων	99.553,50		
II. Ζημιές από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων	-15.926,84		
			83.626,66
Γ. ΕΚΤΑΚΤΑ ΚΑΙ ΑΝΟΡΓΑΝΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ			
I. Λοιπά έκτακτα και ανόργανα έσοδα	4.007,97		
			4.007,97
Δ. ΕΣΟΔΑ ΚΑΙ ΕΞΟΔΑ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ			
I. Έξοδα προηγούμενων χρήσεων	-0,59		
			-0,59
E. ΔΑΠΑΝΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ			
I. Αμοιβή Εταιρείας Διαχείρισης	-1.771.524,70		
II. Αμοιβή Θεματοφυλακής	-177.152,44		
III. Φόροι	-841.474,22		
IV. Τόκοι και Συναφή Έξοδα	-557,40		
V. Έξοδα άρθρου 9 του Κανονισμού	-27.289,20		
			-2.817.997,96
ΚΕΡΔΗ ΠΕΡΙΟΔΟΥ 01.01.2024 - 30.06.2024			<u>2.840.916,82</u>

ΠΙΝΑΚΑΣ ΠΗΓΩΝ ΠΡΟΕΛΕΥΣΕΩΣ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ

ΚΑΙ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΑΠΟ 01.01.2024 - 30.06.2024 (Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)

I. ΚΕΦΑΛΑΙΑ ΜΕΡΙΔΙΟΥΧΩΝ	ΜΕΡΙΔΙΑ	ΑΞΙΑ ΣΕ EUR
ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ Classic D		
Μεριδία σε κυκλοφορία την 31.12.2023	30.698,180	306.851,04
Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.01.2024 - 30.06.2024	41.203.260,488	409.056.384,98
Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.01.2024 - 30.06.2024	<u>-1.849.955,738</u>	-18.405.350,46
Κέρδη Περιόδου 01.01.2024 - 30.06.2024	2.840.916,82	
Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 30.06.2024 ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ Classic D	<u>39.384.002,930</u>	<u>393.798.802,38</u>
Συνολική Αξία Καθαρού Ενεργητικού σε αξίες κτήσεως την 30.06.2024		<u>393.798.802,38</u>
II. ΔΙΑΦΟΡΕΣ ΑΠΟΤΙΜΗΣΗΣ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ		
α. Από Κινητές Αξίες / Μέσα Χρηματαγοράς		
Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2024	387.769.925,99	
Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2024	389.482.641,77	
Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας)	1.712.715,78	
β. Από Λοιπά Στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού		
Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2024	6.028.876,39	
Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2024	6.028.876,39	
Σύνολο από λοιπά στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού	0,00	
Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας) & Λοιπών Στοιχείων Ενεργητικού / Παθητικού		<u>1.712.715,78</u>
ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 30.06.2024		<u>395.511.518,16</u>

ΣΥΓΚΡΙΤΙΚΟΣ ΠΙΝΑΚΑΣ ΤΩΝ ΤΡΙΩΝ ΤΕΛΕΥΤΑΙΩΝ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΙΚΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ			
	ΧΡΗΣΗ 2023	ΧΡΗΣΗ 2022	ΧΡΗΣΗ 2021
ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ Classic D			
ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 31.12	306.985,24	0,00	0,00
ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 31.12	30.698,180	0,000	0,000
ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 31.12	10,0001	0,0000	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 30.06.2024, ήταν εντός του νόμιμου 20% του Καθαρού Ενεργητικού.

Κατά την 30.06.2024 οι επενδύσεις σε κινητές αξίες και μέσα χρηματαγοράς εταιρειών του ίδιου ομίλου αναλύονται ως εξής:

ΟΜΙΛΟΣ/ΕΤΑΙΡΕΙΑ	ΑΞΙΑ ΣΕ EURO	ΠΟΣΟΣΤΟ
Eurobank Ergasias SA	16.561.180,99	4,19 %
- Ομολογίες	16.561.180,99	4,19 %
CITIBANK	1.529.996,81	0,39 %
- Χρηματικά Διαθέσιμα	1.529.996,81	0,39 %
National Bank of Greece SA	11.153.197,46	2,82 %
- Ομολογίες	11.153.197,46	2,82 %
Alpha Services and Holdings SA	35.409.972,13	8,95 %
- Ομολογίες	33.771.793,83	8,54 %
- Χρηματικά Διαθέσιμα	1.638.178,30	0,41 %
BNP PARIBAS	15.023.478,36	3,80 %
- Ομολογίες	15.023.478,36	3,80 %
Morgan Stanley	13.217.535,00	3,34 %
- Ομολογίες	13.217.535,00	3,34 %
JP MORGAN CHASE & CO	8.645.264,38	2,19 %
- Ομολογίες	8.645.264,38	2,19 %
Bank of America Corp	13.844.457,70	3,50 %
- Ομολογίες	13.844.457,70	3,50 %
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA	36.281.887,53	9,17 %
- Ομολογίες	36.281.887,53	9,17 %
BANCO SANTANDER	14.356.804,92	3,63 %
- Ομολογίες	14.356.804,92	3,63 %
FRANCE (GOVT OF)	2.982.390,00	0,75 %
- Ομολογίες	2.982.390,00	0,75 %
Public Power Corp SA	36.587.625,78	9,25 %
- Ομολογίες	36.587.625,78	9,25 %
INTESA SAN PAOLO SPA	10.187.731,80	2,58 %
- Ομολογίες	10.187.731,80	2,58 %
MOTOR OIL FINANCE PLC	2.858.504,11	0,72 %
- Ομολογίες	2.858.504,11	0,72 %
DEUTSCHE BANK	15.955.865,41	4,03 %
- Ομολογίες	15.955.865,41	4,03 %
HSBC Holdings PLC	13.800.751,62	3,49 %
- Ομολογίες	13.800.751,62	3,49 %
UBS Group AG	16.759.656,12	4,24 %
- Ομολογίες	16.759.656,12	4,24 %
Societe Generale SA	5.709.590,66	1,44 %
- Ομολογίες	5.709.590,66	1,44 %
Credit Agricole Group	11.628.757,81	2,94 %
- Ομολογίες	11.628.757,81	2,94 %
ING Groep NV	11.579.958,03	2,93 %
- Ομολογίες	11.579.958,03	2,93 %
BANK OF CYPRUS PCL	35.416.785,90	8,95 %
- Ομολογίες	35.416.785,90	8,95 %
UNICREDIT SPA	6.654.399,67	1,68 %
- Ομολογίες	6.654.399,67	1,68 %
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	2.825.736,58	0,71 %
- Ομολογίες	2.825.736,58	0,71 %
BANCO COMERC PORTUGUES	16.002.671,81	4,05 %
- Ομολογίες	16.002.671,81	4,05 %
SWEDBANK AB	14.106.431,51	3,57 %
- Ομολογίες	14.106.431,51	3,57 %
KBC GROUP NV	9.440.919,18	2,39 %
- Ομολογίες	9.440.919,18	2,39 %
MIZUHO FINANCIAL GROUP	943.438,16	0,24 %
- Ομολογίες	943.438,16	0,24 %
UNICAJA BANCO SA	6.262.587,68	1,58 %
- Ομολογίες	6.262.587,68	1,58 %
STANDARD CHARTERED PLC	10.966.241,64	2,77 %
- Ομολογίες	10.966.241,64	2,77 %

Πίνακας Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων (30.06.2024)				
Εκδότης / Χώρα Έκδοσης / Ημ. Έκδοσης	Isin	Ανάκληση (Callability)	Πηγή Τιμολ.	
Ομόλογα Σταθερού Επιτοκίου				
MOTOR OIL FINANCE PLC / GR / 19.07.2021	XS2364001151	OXI	BGN	NR
Eurobank Ergasias SA / GR / 05.05.2021	XS2338193019	OXI	BGN	BB+
Public Power Corp SA / GR / 18.03.2021	XS2314265237	OXI	BGN	BB-
INTESA SAN PAOLO SPA / IT / 19.11.2019	XS2081018629	OXI	BGN	BBB
National Bank of Greece SA / GR / 08.10.2020	XS2237982769	OXI	BGN	BB
Alpha Services and Holdings SA / GR / 21.10.2022	XS2549772924	OXI	BGN	BB
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 03.11.2021	XS2400040460	OXI	BGN	BB-
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA / GR / 02.11.2022	XS2559486019	OXI	BGN	BB-
Alpha Services and Holdings SA / GR / 16.12.2022	XS2562213145	OXI	BGN	BB
BANK OF CYPRUS PCL / CY / 16.06.2021	XS2355059168	OXI	BGN	BB
HSBC Holdings PLC / GB / 07.06.2022	XS2486589596	OXI	BGN	A-
Credit Agricole Group / FR / 13.04.2022	FR0014009UH8	OXI	BGN	A-
Bank of America Corp / US / 20.04.2022	XS2462324232	OXI	BGN	A
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG / ES / 16.03.2021	XS2322289385	OXI	BGN	A-
UNICREDIT SPA / IT / 12.01.2021	XS2289133915	OXI	BGN	BBB
STANDARD CHARTERED PLC / GB / 25.06.2019	XS2021467753	OXI	BGN	A-
DEUTSCHE BANK / DE / 05.02.2019	DE000DL19US6	OXI	BGN	BBB+
UBS Group AG / CH / 17.03.2022	CH1174335732	OXI	BGN	A-
BNP PARIBAS / FR / 06.04.2021	FR0014002X43	OXI	BGN	A-
ING Groep NV / NL / 09.02.2022	XS2443920249	OXI	BGN	A-
KBC GROUP NV / BE / 24.11.2021	BE0002832138	OXI	BGN	A-
BANCO COMERC PORTUGUES / PT / 25.09.2023	PTBPC2OM0058	OXI	BGN	BBB-
INTESA SAN PAOLO SPA / IT / 15.05.2023	XS2625195891	OXI	BGN	BBB
JP MORGAN CHASE & CO / US / 28.02.2019	XS1960248919	OXI	BGN	A
Morgan Stanley / US / 18.10.2017	XS1706111793	OXI	BGN	A
BANCO SANTANDER / ES / 20.09.2022	XS2538366878	OXI	BGN	A
UNICAJA BANCO SA / ES / 24.11.2021	ES0380907040	OXI	BGN	BBB-
MIZUHO FINANCIAL GROUP / JP / 06.04.2021	XS2329143510	OXI	BGN	A
Societe Generale SA / FR / 08.11.2021	FR0014006IU2	OXI	BGN	A
SWEDBANK AB / SE / 12.05.2021	XS2343563214	OXI	BGN	A-
Ομόλογα Zero Coupon				
FRANCE (GOVT OF) / FR / 27.05.2024	FR0128379429	OXI	BGN	AA-

I. ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗ ΘΕΣΗ (ΙΣΟΛΟΓΙΣΜΟΣ) της 30.06.2024
(N.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.11 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

	30.06.2024	31.12.2023	31.12.2022
Μεταβιβάσιμοι Τίτλοι	389.482.641,77	299.367,00	0,00
Καταθέσεις σε τράπεζες	3.168.175,11	306.982,65	0,00
Λοιπά περιουσιακά στοιχεία	4.058.992,57	0,00	0,00
Σύνολο περιουσιακών στοιχείων	396.709.809,45	606.349,65	0,00
Υποχρεώσεις	-1.198.291,29	-299.364,41	0,00
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων	395.511.518,16	306.985,24	0,00
Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία Subfund	39.384.002.930	30.698,180	0,000
Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια)	10,0424	10,0001	-
Ανάλυση Χαρτοφυλακίου			
1. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε επίσημο χρηματιστήριο αξιών	0,00	0,00	0,00
2. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε άλλες ρυθμιζόμενες αγορές	389.482.641,77	299.367,00	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	0,00	0,00	0,00
Σύνολο	389.482.641,77	299.367,00	0,00

II. ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΞΕΛΙΞΗΣ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΩΝ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ Περιόδου 01.01.2024 έως 30.06.2024
 (Ν.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.12 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

			01.01.-30.06.24	01.01.-30.06.23	01.01.-30.06.22
A. Κατάσταση Αποτελεσμάτων Περιόδου					
Εισόδημα από επενδύσεις	5.571.280,74	0,00	0,00		
Κέρδη / (Ζημιές) από αγοραπωλησίες κινητών αξιών / μέσων χρηματαγοράς			83.626,66	0,00	0,00
Λοιπά εισοδήματα	4.007,38	0,00	0,00		
Έξοδα διαχείρισης	-1.771.524,70	0,00	0,00		
Έξοδα θεματοφύλακα	-177.152,44	0,00	0,00		
Λοιπά έξοδα και φόροι	-869.320,82			0,00	0,00
Καθαρό εισόδημα			2.840.916,82	0,00	0,00
B. Κατάσταση λοιπών μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων αποτελεσμάτων περιόδου					
Έκδοση νέων μεριδίων	409.056.384,98	0,00	0,00		
Εξαγορές μεριδίων	-18.405.350,46	0,00	0,00		
Διαφορές επιμέτρησης επενδύσεων	1.712.581,58			0,00	0,00
Σύνολο			392.363.616,10	0,00	0,00
Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B) περιόδου 01.01-30.06			395.204.532,92	0,00	0,00
Γ. Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων περιόδου 01.07-31.12			0,00	306.985,24	0,00
Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B+Γ)			395.204.532,92	306.985,24	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 και των ομολόγων εξωτερικού έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των δημοσιευμένων τιμών κλεισίματος Bloomberg (όπως ορίζεται στην πηγή τιμολόγησης στον Πίνακα Επενδύσεων Ομολογιακών Τίτλων) της 28.06.2024 (καθώς η 30.06.2024 ήταν αργία). Η τρέχουσα αξία ορίζεται ως το γινόμενο της ονομαστικής αξίας επί τρέχουσα τιμή /100.
- Οι δεδουλευμένοι τόκοι των ομολογιακών δανείων (μείον οι τόκοι που καταβλήθηκαν για την αγορά τους) περιλαμβάνονται στα έσοδα της περιόδου 01.01.2024 - 30.06.2024 και απεικονίζονται στους μεταβατικούς λογαριασμούς του Ενεργητικού.
- Οι καταθέσεις ύψους που περιλαμβάνονται στην κατηγορία Καταθέσεις σε Πιστωτικά Ιδρύματα αποτιμήθηκαν στην λογιστική τους αξία κατά την 30.06.2024, η οποία δε διαφέρει από την εύλογη αξία τους. Οι δεδουλευμένοι τόκοι των καταθέσεων ύψους έως και την 30.06.2024, περιλαμβάνονται στα έσοδα της περιόδου 01.01.2024 - 30.06.2024 και απεικονίζονται στους μεταβατικούς λογαριασμούς του Ενεργητικού.
- Ως πιστοληπτική διαβάθμιση των Treasury-Bills εξωτερικού και των ομολόγων 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.
- 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.
- Στον πίνακα προέλευσης καθαρού ενεργητικού και αποτελεσμάτων από 01.01.2024 - 30.06.2024 η αξία των μεριδίων 31.12.2023 εμφανίζεται σε κόστος κτήσεως.
- Η κατηγοριοποίηση της αξίας των χρηματοοικονομικών στοιχείων του ενεργητικού του αμοιβαίου κεφαλαίου έχει ως εξής :

	Κατηγορία 1	Κατηγορία 2	Κατηγορία 3	Σύνολο
Ομόλογα	386.500.251,77	-	-	386.500.251,77
Μέσα Χρηματαγοράς	2.982.390,00	-	-	2.982.390,00
Σύνολο	389.482.641,77	0,00	0,00	389.482.641,77

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.

Αθήνα, 29.08.2024

 Ο Θεματοφύλακας
 ALPHA BANK

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

Π.Σ. ΡΑΥΤΟΠΟΥΛΟΣ

Ε.Α. 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 TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ”

Έκθεση Ελέγχου επί της Εξαμηνιαίας Έκθεσης Διαχείρισης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ”

Γνώμη

Έχουμε ελέγξει την Εξαμηνιαία Έκθεση Διαχείρισης της εξάμηνης περιόδου που έληξε την 30^η Ιουνίου 2024 (01.01.2024-30.06.2024) του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ” (η Έκθεση Διαχείρισης), που καταρτίστηκε από τη διαχειρίστρια της περιουσίας του εταιρεία “ΑΛΦΑ ASSET MANAGEMENT ΜΟΝΟΠΡΟΣΩΠΗ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΕΩΣ ΑΜΟΙΒΑΙΩΝ ΚΕΦΑΛΑΙΩΝ” (η Διαχειρίστρια Εταιρεία) και περιλαμβάνει την Χρηματοοικονομική θέση (Ισολογισμό), την κατάσταση εξέλιξης των καθαρών περιουσιακών στοιχείων περιόδου, καθώς και τις λοιπές πληροφορίες, τα στοιχεία και τις επεξηγηματικές σημειώσεις του ως άνω Αμοιβαίου Κεφαλαίου.

Κατά τη γνώμη μας, η ανωτέρω Έκθεση Διαχείρισης παρουσιάζει εύλογα, από κάθε ουσιώδη άποψη, τη χρηματοοικονομική θέση του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA TARGET MATURITY VI 2026 ΟΜΟΛΟΓΙΑΚΟ ΑΜΟΙΒΑΙΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ” κατά την 30^η Ιουνίου 2024 και τη χρηματοοικονομική του επίδοση για την εξάμηνη περίοδο 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 Διαχείρισης”.

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 Διαχείρισης 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 Διαχείρισης 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 επί της Έκθεσης Διαχείρισης

Η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας έχει την ευθύνη για την κατάρτιση και εύλογη παρουσίαση της Έκθεσης Διαχείρισης, 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 Διαχείρισης, απαλλαγμένης από ουσιώδες σφάλμα, που οφείλεται είτε σε απάτη είτε σε λάθος.

Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισης

Οι στόχοι μας είναι να αποκτήσουμε εύλογη διασφάλιση για το κατά πόσο η Έκθεση Διαχείρισης 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 Διαχείρισης.

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 Διαχείρισης, 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 Διαχείρισης, συμπεριλαμβανομένων των γνωστοποιήσεων, καθώς και το κατά πόσο η Έκθεση Διαχείρισης 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, 30 Αυγούστου 2024

Η Ορκωτός Ελεγκτής Λογιστής

Φωτεινή Γιαννοπούλου

A.M. ΣΟΕΛ: 24031

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.