

ΤΕΑ ΑΣΤΥΝΟΜΙΚΩΝ-ΠΥΡΟΣΒΕΣΤΩΝ-ΛΙΜΕΝΙΚΩΝ ΜΙΚΤΟ INSTITUTIONAL SHARE CLASS
Μικτό

Άδεια σύστασης : Απόφ. Επιτρ. Κεφαλαιαγοράς 256/02.06.2016

ISIN : GRF000154002

| ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ ΤΕΑ ΑΣΤΥΝΟΜΙΚΩΝ-ΠΥΡΟΣΒΕΣΤΩΝ-ΛΙΜΕΝΙΚΩΝ ΜΙΚΤΟ INSTITUTIONAL SHARE CLASS της 31/12/2018 | | | | |
|--|---|----------------|--|---|
| Σύνθεση Ενεργητικού Αμοιβαίου Κεφαλαίου | | Τεμάχια | Τιμή Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου σε ευρώ | Συνολική Αξία Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου σε ευρώ |
| I | ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 1 | Διαθέσιμα - Καταθέσεις | | | |
| | Καταθέσεις όψεως Τράπεζας Πειραιώς σε EURO | | | 635.981,51 |
| | Καταθέσεις Προθεσμίας Alpha Bank σε EURO | | | 301.898,48 |
| | Καταθέσεις όψεως Τράπεζας Πειραιώς σε GBP | | | 1.063,77 |
| | Καταθέσεις όψεως Τράπεζας Πειραιώς σε CHF | | | 2.967,90 |
| | Σύνολο I.1. | | | 941.911,66 |
| 3 | Ομολογίες - ΕΓΕΔ | | | |
| | ΕΓΕΔ 16/03/2018-15/03/2019 | 10.000,00 | 99,750 | 997.500,00 |
| | ΕΓΕΔ 06/07/2018-04/01/2019 | 5.000,00 | 99,990 | 499.950,00 |
| | ΕΓΕΔ 31/08/2018-01/03/2019 | 11.000,00 | 99,800 | 1.097.800,00 |
| | ΕΓΕΔ 14/09/2018-13/09/2019 | 10.000,00 | 99,130 | 991.300,00 |
| | ΕΓΕΔ 02/11/2018-03/05/2019 | 10.000,00 | 99,580 | 995.800,00 |
| | ΕΓΕΔ 09/11/2018-08/02/2019 | 6.000,00 | 99,880 | 599.280,00 |
| | ΕΓΕΔ 07/12/2018-07/06/2019 | 10.000,00 | 99,460 | 994.600,00 |
| | ΕΓΕΔ 14/12/2018-13/12/2019 | 7.000,00 | 98,820 | 691.740,00 |
| | ΟΕΔ 1/8/2017-1/8/2022 | 5.000,00 | 104,050 | 520.250,00 |
| | ΟΕΔ 5/12/2017-30/1/2023 | 3.635,00 | 100,800 | 366.408,00 |
| | ΟΕΔ 15/2/2018-15/2/2025 | 3.000,00 | 96,500 | 289.500,00 |
| | ΟΕΔ 5/12/2017-30/1/2028 | 6.580,00 | 95,400 | 627.732,00 |
| | ΟΕΔ 5/12/2017-30/1/2033 | 3.617,50 | 90,960 | 329.047,80 |
| | ΟΕΔ 5/12/2017-30/1/2037 | 3.726,24 | 87,950 | 327.722,81 |
| | ΟΕΔ 5/12/2017-30/1/2042 | 5.298,75 | 87,800 | 465.230,25 |
| | ΟΠΑΠ 21/3/2017-21/3/2022 | 900,00 | 101,6500 | 91.485,00 |
| | MYTILILEOS HOLDINGS 27/6/2017-27/6/2022 | 2.260,00 | 100,6895 | 227.558,27 |
| | NBG 19/10/2017-19/10/2020 | 5.000,00 | 101,553 | 507.765,00 |
| | EUROBANK 02/11/2017-02/11/2020 | 1.000,00 | 101,334 | 101.334,00 |
| | CORAL A.E. 11/05/2018-11/05/2023 | 880,00 | 100,600 | 88.528,00 |
| | Σύνολο I.3. | | | 10.810.531,13 |
| 4 | Μετοχές | | | |
| | Μετοχές Εισηγμένες στο ΧΑ | | | |
| | ALPHA ΤΡΑΠΕΖΑ Α.Ε (ΚΟ) | 60.000 | 1,1000 | 66.000,00 |
| | ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε (ΚΟ) | 30.000 | 1,1000 | 33.000,00 |
| | ΤΡΑΠΕΖΑ EUROBANK ERGASIAS Α.Ε. (ΚΟ) | 330.000 | 0,5400 | 178.200,00 |
| | ΕΛΛΗΝΙΚΑ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑ - ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΘΗΝΩΝ | | | |
| | ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΙΑ ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ (ΚΟ) | 6.000 | 3,7000 | 22.200,00 |
| | GRIVALIA PROPERTIES Α.Ε.Α.Π. (ΚΟ) | 5.600 | 8,3600 | 46.816,00 |
| | ΟΤΕ Α.Ε (ΚΟ) | 11.000 | 9,5200 | 104.720,00 |
| | TITAN ΑΝ.ΕΤ.ΤΣΙΜΕΝΤΩΝ (ΚΟ) | 12.000 | 19,3800 | 232.560,00 |
| | ΕΛΛΗΝΙΚΑ ΠΕΤΡΕΛΑΙΑ Α.Ε. (ΚΟ) | 32.000 | 7,3800 | 236.160,00 |
| | ΜΟΤΟΡ ΟΙΛ (ΕΛΛΑΣ) ΔΙΓΥΛΙΣΤΗΡΙΑ ΚΟΡΙΝΘΟΥ Α.Ε. (ΚΟ) | 4.000 | 21,0000 | 84.000,00 |
| | ΑΔΜΗΕ ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε.(ΚΟ) | 30.000 | 1,5460 | 46.380,00 |
| | QUEST ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε.(ΚΟ) | 4.500 | 13,4000 | 60.300,00 |
| | ΟΠΑΠ ΑΕ (ΚΟ) | 15.200 | 7,5950 | 115.444,00 |
| | ΑΕΡΟΠΟΡΙΑ ΛΙΓΑΙΟΥ Α.Α.Ε. (ΚΟ) | 10.000 | 7,3800 | 73.800,00 |
| | ΣΑΡΑΝΤΗΣ ΓΡ. Α.Β.Ε.Ε. (ΚΟ) | 20.000 | 6,9800 | 139.600,00 |
| | FOURLIS ΑΕ ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ (ΚΟ) | 6.600 | 4,1000 | 27.060,00 |
| | ΜΥΤΙΑΗΝΑΙΟΣ Α.Ε. (ΚΟ) | 8.000 | 7,2900 | 58.320,00 |
| | Σύνολο I.4. | | | 1.524.560,00 |
| | Σύνολο Επενδύσεων Εσωτερικού (I) | | | 13.277.002,79 |

| ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ ΤΕΑ ΑΣΤΥΝΟΜΙΚΩΝ-ΠΥΡΟΣΒΕΣΤΩΝ-ΛΙΜΕΝΙΚΩΝ ΜΙΚΤΟ INSTITUTIONAL SHARE CLASS της 31/12/2018 | | | | |
|--|---|---------|---|--|
| Σύνθεση Ενεργητικού Αμοιβαίου Κεφαλαίου | | Τεμάχια | Τιμή Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου σε ευρώ | Συνολική Αξία Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου σε ευρώ |
| II | ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| 3 | Ομολογίες | | | |
| | OTE PLC 10/07/2014-09/07/2020 | 2.000 | 102,9620 | 205.924,00 |
| | TITAN GLOBAL 17/06/16-17/06/21 | 2.000 | 101,4200 | 202.840,00 |
| | COCA-COLA HBC 10/03/2016-11/11/2024 | 1.000 | 105,1640 | 105.164,00 |
| | MOTOR OIL 10/4/2017-1/4/2022 | 1.000 | 100,7470 | 100.747,00 |
| | Σύνολο Π.3. | | | 614.675,00 |
| 4 | Μετοχές Εισηγμένες | | | |
| | ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΘΗΝΩΝ | | | |
| | COCA COLA HBC AG | 3.200 | 27,1100 | 86.752,00 |
| | ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΠΑΡΙΣΙΟΥ (ΣΕ EUR) | | | |
| | TOTAL SA | 319 | 46,180 | 14.731,42 |
| | GROUP DANONE | 156 | 61,510 | 9.595,56 |
| | ORANGE SA | 3.000 | 14,155 | 42.465,00 |
| | ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΖΥΡΙΧΗΣ (ΣΕ CHF) ΙΣΟΤΙΜΙΑ 1,1269 | | | |
| | NESTLE SA | 700 | 70,814 | 49.569,62 |
| | ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΛΟΝΔΙΝΟΥ (ΣΕ GBP) ΙΣΟΤΙΜΙΑ 0,89453 | | | |
| | BP AMOCO | 4.523 | 5,5443 | 25.076,65 |
| | UNILEVER PLC | 314 | 45,9291 | 14.421,75 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 8.884 | 1,709 | 15.185,23 |
| | ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΦΡΑΝΚΦΟΥΡΤΗΣ (ΣΕ EUR) | | | |
| | SAP AG | 400 | 86,930 | 34.772,00 |
| | CONTINENTAL AG | 250 | 120,750 | 30.187,50 |
| | ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΜΑΔΡΙΤΗΣ (ΣΕ EUR) | | | |
| | INDITEX SA | 600 | 22,350 | 13.410,00 |
| | Σύνολο Π.4. | | | 336.166,73 |
| | Σύνολο Επενδύσεων Εξωτερικού (II) | | | 950.841,73 |
| | ΣΥΝΟΛΟ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) | | | 14.227.844,52 |
| | Απαιτήσεις - Υποχρεώσεις | | | 9.906,99 |
| | ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ | | | 14.237.751,51 |

Κηφισιά 11 Ιανουαρίου 2019

Για την ALPHA TRUST Ανώνυμη Εταιρεία Διαχείρισης Αμοιβαίων Κεφαλαίων και Οργανισμών Εναλλακτικών Επενδύσεων

Ιωσήφ Παπαδογιάννης
 Διευθυντής Επενδύσεων

Σοφία Ζευκλή
 Head of Back Office

| TEA ΑΣΤΥΝΟΜΙΚΩΝ-ΠΥΡΟΣΒΕΣΤΩΝ-ΑΙΜΕΝΙΚΩΝ ΜΙΚΤΟ INSTITUTIONAL SHARE CLASS - Πλήρης ανάλυση χαρακτηριστικών χρεωστικών τίτλων και μέσων χρηματαγοράς της | | | | | | | | | | | | 31/12/2018 | | |
|---|---------------|---------|------------------|---------------|---------------|-----------------------|--------------------|------------------|----------|-----------------|----------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------|
| Ομολογίες σταθερού επιτοκίου | | | | | | | | | | | | | | |
| Εκδότης | Κωδικός ISIN | Τεμάχια | Μονάδα Διαπραγμ. | Τρέχουσα Τιμή | Συνολική Αξία | Συνολική Αξία σε euro | Ημερομηνία Έκδοσης | Ημερομηνία Λήξης | Κουπόνι* | Πηγή Αποτίμησης | Πιστοληπτική διαβάθμιση Moodys** | Πιστοληπτική διαβάθμιση S&P** | Πιστοληπτική διαβάθμιση Fitch** | Άλλοι όροι |
| HELLENIC REPUBLIC | GR0114029540 | 500 | 1.000 | 104,0500 | 520.250,00 | 520.250,00 | 01/08/2017 | 01/08/2022 | 4,375 | BGN | B3 | B+ | BB- | - |
| HELLENIC REPUBLIC | GR0114030555 | 363.500 | 1 | 100,8000 | 366.408,00 | 366.408,00 | 05/12/2017 | 30/01/2023 | 3,5 | BGN | - | B+ | BB- | - |
| HELLENIC REPUBLIC | GR0118017657 | 300 | 1.000 | 96,5000 | 289.500,00 | 289.500,00 | 15/02/2018 | 15/02/2025 | 3,375 | BGN | B3 | B+ | BB- | - |
| HELLENIC REPUBLIC | GR0124034688 | 658.000 | 1 | 95,4000 | 627.732,00 | 627.732,00 | 05/12/2017 | 30/01/2028 | 3,75 | BGN | - | B+ | BB- | - |
| HELLENIC REPUBLIC | GR0128015725 | 361.750 | 1 | 90,9600 | 329.047,80 | 329.047,80 | 05/12/2017 | 30/01/2033 | 3,9 | BGN | - | B+ | BB- | - |
| HELLENIC REPUBLIC | GR0133011248 | 372.624 | 1 | 87,9500 | 327.722,81 | 327.722,81 | 05/12/2017 | 30/01/2037 | 4 | BGN | - | B+ | BB- | - |
| HELLENIC REPUBLIC | GR0138015814 | 529.875 | 1 | 87,8000 | 465.230,25 | 465.230,25 | 05/12/2017 | 30/01/2042 | 4,2 | BGN | - | B+ | BB- | - |
| OPAP SA | GRC4191173B0 | 90 | 1.000 | 101,6500 | 91.485,00 | 91.485,00 | 21/03/2017 | 21/03/2022 | 3,5 | ASE | - | BB- | - | ΣΗΜ 1 |
| MYTILINEOS HOLDINGS SA | GRC3931176B0 | 226 | 1.000 | 100,6895 | 227.558,27 | 227.558,27 | 27/06/2017 | 27/06/2022 | 3,1 | ASE | - | - | - | ΣΗΜ 2 |
| NATIONAL BANK GREECE SA | XSI698932925 | 5 | 100.000 | 101,5530 | 507.765,00 | 507.765,00 | 19/10/2017 | 19/10/2020 | 2,75 | BGN | Ba2 | B- | BBB- | - |
| EUROBANK ERGASIAS SA | XSI709545641 | 1 | 100.000 | 101,3340 | 101.334,00 | 101.334,00 | 02/11/2017 | 02/11/2020 | 2,75 | BGN | Ba2 | B- | - | - |
| CORAL AE OIL CHEMICALS | GRC8161185B1 | 88 | 1.000 | 100,6000 | 88.528,00 | 88.528,00 | 11/05/2018 | 11/05/2023 | 3 | ASE | - | - | - | - |
| OTE PLC | XSI1086785182 | 2 | 100.000 | 102,9620 | 205.924,00 | 205.924,00 | 10/07/2014 | 09/07/2020 | 3,5 | BGN | B1u | - | - | - |
| TITAN GLOBAL FINANCE PLC | XSI1429814830 | 2 | 100.000 | 101,4200 | 202.840,00 | 202.840,00 | 17/06/2016 | 17/06/2021 | 3,5 | BGN | - | BB+ | - | - |
| COCA-COLA HBC FINANCE BV | XSI1377682676 | 1 | 100.000 | 105,1640 | 105.164,00 | 105.164,00 | 10/03/2016 | 11/11/2024 | 1,875 | BGN | Baa1 | - | - | - |
| MOTOR OIL FINANCE PLC | XSI586710185 | 1 | 100.000 | 100,7470 | 100.747,00 | 100.747,00 | 10/04/2017 | 01/04/2022 | 3,25 | BGN | - | - | - | ΣΗΜ 3 |
| Έντοκα γραμμάτια Ελληνικού Δημοσίου | | | | | | | | | | | | | | |
| Εκδότης | Κωδικός ISIN | Τεμάχια | Μονάδα Διαπραγμ. | Τρέχουσα Τιμή | Συνολική Αξία | Συνολική Αξία σε euro | Ημερομηνία Έκδοσης | Ημερομηνία Λήξης | Κουπόνι* | Πηγή Αποτίμησης | Πιστοληπτική διαβάθμιση Moodys** | Πιστοληπτική διαβάθμιση S&P** | Πιστοληπτική διαβάθμιση Fitch** | Άλλοι όροι |
| HELLENIC T-BILL | GR0004111374 | 1.000 | 1.000 | 99,7500 | 997.500,00 | 997.500,00 | 16/03/2018 | 15/03/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | B | - |
| HELLENIC T-BILL | GR0002177435 | 500 | 1.000 | 99,9900 | 499.950,00 | 499.950,00 | 06/07/2018 | 04/01/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | - | - |
| HELLENIC T-BILL | GR0002180462 | 1.100 | 1.000 | 99,8000 | 1.097.800,00 | 1.097.800,00 | 31/08/2018 | 01/03/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | - | - |
| HELLENIC T-BILL | GR0004113396 | 1.000 | 1.000 | 99,1300 | 991.300,00 | 991.300,00 | 14/09/2018 | 13/09/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | - | - |
| HELLENIC T-BILL | GR0002182484 | 1.000 | 1.000 | 99,5800 | 995.800,00 | 995.800,00 | 02/11/2018 | 03/05/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | - | - |
| HELLENIC T-BILL | GR0000188913 | 600 | 1.000 | 99,8800 | 599.280,00 | 599.280,00 | 09/11/2018 | 08/02/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | - | - |
| HELLENIC T-BILL | GR0002183490 | 1.000 | 1.000 | 99,4600 | 994.600,00 | 994.600,00 | 07/12/2018 | 07/06/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | - | - |
| HELLENIC T-BILL | GR0004114402 | 700 | 1.000 | 98,8200 | 691.740,00 | 691.740,00 | 14/12/2018 | 13/12/2019 | 0 | ΗΔΑΤ | - | B+ | - | - |

* Το κουπόνι αναφέρεται στο τρέχον επιτόκιο της 31ης Δεκεμβρίου 2018

** Τα στοιχεία πιστοληπτικής διαβάθμισης έχουν ληφθεί από το Bloomberg με ημερομηνία 31/12/2018

Σημειώσεις-Πρόσθετα στοιχεία

ΣΗΜ 1 Ανακλήσιμο την 21/3/2020 στην ονομαστική τιμή.

ΣΗΜ 2 Ανακλήσιμο την 27/12/2020 στην ονομαστική τιμή.

ΣΗΜ 3 Ανακλήσιμο από τον εκδότη στις πιο κάτω ημερομηνίες και τιμές 1/4/2019 101,625. Στην περίπτωση ανάκλησης νωρίτερα από αυτή την ημερομηνία, η τιμή ανάκλησης υπολογίζεται με βάση την απόδοση του ομολόγου που προκύπτει από την προσαύξηση της απόδοσης του Γερμανικού ομολόγου αναφοράς κατά 50 μονάδες βάσης.

Υπόμνημα Πηγών αποτίμησης

Για την αποτίμηση των ομολόγων του χαρτοφυλακίου χρησιμοποιούνται τιμές ζήτησης από Bloomberg. Όπου:

BGN: Bloomberg Generic prices

ASE: Τιμές κλεισίματος Χρηματιστηρίου Αθηνών

Για τιμές Εντόκων Γραμματίου Ελληνικού Δημοσίου χρησιμοποιούνται τιμές κλεισίματος ΗΔΑΤ