



ALPHA ΑΜΟΙΒΑΙΑ ΚΕΦΑΛΑΙΑ

ΘΕΜΑΤΟΦΥΛΑΚΑΣ: ALPHA BANK Α.Ε.

ΕΤΗΣΙΑ ΕΚΘΕΣΗ

ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ
ΔΙΑΠΡΑΓΜΕΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ

ΟΚΤΩΒΡΙΟΣ 2024

ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ
 Αρ.Εγκρ.789/13.12.2007 ΦΕΚ 2474/Β/31/12/2007
 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 30.06.2024
 Χρήση 01.07.2023 - 30.06.2024
 (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 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 | | | | | | |
| ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | | | | |
| ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α | | | | | | |
| ΑΚΙΝΗΤΗ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑ | | | | | | |
| LAMDA DEVELOPMENT Α.Ε. (ΚΟ) | 61.827 | 6,7400 | | <u>416.713,98</u> | 1,28 % | 1,34 % |
| | | | | 416.713,98 | 1,28 % | 1,34 % |
| ΒΙΟΜΗΧΑΝΙΚΑ ΠΡΟΪΟΝΤΑ ΚΑΙ ΥΠΗΡΕΣΙΕΣ | | | | | | |
| ΜΥΤΙΛΗΝΑΙΟΣ Α.Ε. | 82.223 | 34,8600 | | 2.866.293,78 | 8,80 % | 9,19 % |
| ATHENS INTERNATIONAL AIRPORT | 41.510 | 7,8500 | | <u>325.853,50</u> | 1,00 % | 1,04 % |
| | | | | 3.192.147,28 | 9,81 % | 10,23 % |
| ΕΜΠΟΡΙΟ | | | | | | |
| JUMBO ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΜΠΟΡΙΚΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ (ΚΟ) | 80.320 | 26,8800 | | <u>2.159.001,60</u> | 6,63 % | 6,92 % |
| | | | | 2.159.001,60 | 6,63 % | 6,92 % |
| ΚΑΤΑΣΚΕΥΕΣ ΚΑΙ ΥΛΙΚΑ ΚΑΤΑΣΚΕΥΩΝ | | | | | | |
| ΕΛΛΑΚΤΩΡ Α.Ε. (ΚΟ) | 61.150 | 2,4700 | | 151.040,50 | 0,46 % | 0,48 % |
| ΓΕΚ-ΤΕΡΝΑ Α.Ε. ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ (ΚΟ) | 47.429 | 16,5400 | | <u>784.475,66</u> | 2,41 % | 2,52 % |
| | | | | 935.516,16 | 2,87 % | 3,00 % |
| ΠΕΤΡΕΛΑΙΟ ΚΑΙ ΑΕΡΙΟ | | | | | | |
| ΜΟΤΟΡ ΟΙΛ(ΕΛΛΑΣ) ΔΙΥΛ.ΚΟΡΙΝΘΟΥ Α.Ε.(ΚΟ) | 47.717 | 23,4400 | | 1.118.486,48 | 3,44 % | 3,59 % |
| HELLENIQ ENERGY Ανωνυμη Εταιρεια Συμμετοχων | 64.720 | 7,8000 | | <u>504.816,00</u> | 1,55 % | 1,62 % |
| | | | | 1.623.302,48 | 4,99 % | 5,20 % |
| ΠΡΟΣΩΠΙΚΑ ΚΑΙ ΟΙΚΙΑΚΑ ΑΓΘΑ | | | | | | |
| ΓΡ.ΣΑΡΑΝΤΗΣ Α.Β.Ε.Ε. (ΚΟ) | 17.052 | 10,8000 | | 184.161,60 | 0,57 % | 0,59 % |
| AUTOHELLAS ΑΝΩΝ ΤΟΥΡ & ΕΜΠ ΕΤΑΙΡΕΙΑ (ΚΟ) | 14.200 | 11,3200 | | <u>160.744,00</u> | 0,49 % | 0,52 % |
| | | | | 344.905,60 | 1,06 % | 1,11 % |
| ΠΡΩΤΕΣ ΥΛΕΣ | | | | | | |
| ELVALHALCOR SA | 43.806 | 1,7640 | | <u>77.273,78</u> | 0,24 % | 0,25 % |
| | | | | 77.273,78 | 0,24 % | 0,25 % |
| ΤΑΞΙΔΙΑ ΚΑΙ ΑΝΑΨΥΧΗ | | | | | | |
| ΟΠΑΠ Α.Ε. (ΚΟ) | 140.246 | 14,6400 | | 2.053.201,44 | 6,31 % | 6,58 % |
| ΑΕΡΟΠΟΡΙΑ ΑΙΓΑΙΟΥ ΑΕ (ΚΟ) | 29.672 | 11,6800 | | <u>346.568,96</u> | 1,06 % | 1,11 % |
| | | | | 2.399.770,40 | 7,37 % | 7,69 % |
| ΤΗΛΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΕΣ | | | | | | |
| ΟΤΕ Α.Ε. (ΚΟ) | 136.785 | 13,4400 | | <u>1.838.390,40</u> | 5,65 % | 5,89 % |
| | | | | 1.838.390,40 | 5,65 % | 5,89 % |
| ΤΡΑΠΕΖΕΣ | | | | | | |
| PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA | 746.152 | 3,4060 | | 2.541.393,71 | 7,81 % | 8,15 % |
| ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε (ΚΟ) | 396.838 | 7,7840 | | 3.088.986,99 | 9,49 % | 9,90 % |
| ALPHA ΥΠΗΡΕΣΙΩΝ ΚΑΙ ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΙΑ | 1.525.134 | 1,5235 | | 2.323.541,65 | 7,14 % | 7,45 % |
| EUROBANK ERGASIAS ΥΠΗΡΕΣΙΩΝ ΚΑΙ ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε. | 1.526.539 | 2,0210 | | <u>3.085.135,32</u> | 9,48 % | 9,89 % |
| | | | | 11.039.057,67 | 33,91 % | 35,39 % |
| ΥΠΗΡΕΣΙΕΣ ΚΟΙΝΗΣ ΩΦΕΛΕΙΑΣ | | | | | | |
| Ε.ΥΔ.Α.Π. Α.Ε. (ΚΟ) | 30.160 | 5,4800 | | 165.276,80 | 0,51 % | 0,53 % |
| ΔΕΗ Α.Ε.(ΚΟ) | 155.906 | 11,2400 | | 1.752.383,44 | 5,38 % | 5,62 % |
| ΤΕΡΝΑ ΕΝΕΡΓΕΙΑΚΗ Α.Β.Ε.Τ.Ε (ΚΟ) | 39.574 | 19,4900 | | <u>771.297,26</u> | 2,37 % | 2,47 % |
| | | | | 2.688.957,50 | 8,26 % | 8,62 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α | | | | <u>26.715.036,85</u> | 82,07 % | 85,64 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | | <u>26.715.036,85</u> | 82,07 % | 85,64 % |
| ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | | | | |
| ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΘΗΝΩΝ | | | | | | |
| ΚΑΤΑΣΚΕΥΕΣ ΚΑΙ ΥΛΙΚΑ ΚΑΤΑΣΚΕΥΩΝ | | | | | | |
| TITAN CEMENT INTERNATIONAL S.A. | 30.461 | 29,2500 | | <u>890.984,25</u> | 2,74 % | 2,86 % |
| | | | | 890.984,25 | 2,74 % | 2,86 % |
| ΒΙΟΜΗΧΑΝΙΚΑ ΠΡΟΪΟΝΤΑ & ΥΠΗΡΕΣΙΕΣ | | | | | | |
| CENERGY HOLDINGS SA | 26.250 | 9,5900 | | <u>251.737,50</u> | 0,77 % | 0,81 % |
| | | | | 251.737,50 | 0,77 % | 0,81 % |

| | | | | | |
|---|--------|---------|-----------------------------|-----------------|-----------------|
| ΒΙΟΜΗΧΑΝΙΚΑ ΠΡΟΪΟΝΤΑ | | | | | |
| VIOHALCO S.A. GA | 32.224 | 5,6900 | <u>183.354,56</u> | 0,56 % | 0,59 % |
| | | | 183.354,56 | 0,56 % | 0,59 % |
| ΤΡΟΦΙΜΑ & ΠΟΤΑ | | | | | |
| COCA-COLA HBC AG | 99.407 | 31,5000 | <u>3.131.320,50</u> | 9,62 % | 10,04 % |
| | | | 3.131.320,50 | 9,62 % | 10,04 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΜΕΤΟΧΩΝ ΕΙΣΗΓΜΕΝΩΝ ΣΤΟ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΘΗΝΩΝ | | | <u>4.457.396,81</u> | 13,69 % | 14,30 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | <u>4.457.396,81</u> | 13,69 % | 14,30 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ | | | <u>31.172.433,66</u> | 95,76 % | 99,94 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ | | | <u>31.172.433,66</u> | 95,76 % | 99,94 % |
| ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ | | | | | |
| ΧΡΕΩΣΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ | | | 1.007.829,01 | 3,10 % | 3,35 % |
| ΜΕΡΙΣΜΑΤΑΠΟΔΕΙΞΕΙΣ ΕΙΣΠΡΑΚΤΕΕΣ | | | 267.247,30 | 0,82 % | 0,74 % |
| ΜΕΤΑΒΑΤΙΚΟΙ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΙ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ | | | 234,96 | 0,00 % | 0,00 % |
| ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΔΗΜΟΣΙΟ ΠΑΡΑΚΡΑΤΗΜΕΝΟΙ ΦΟΡΟΙ | | | 1.852,03 | 0,01 % | 0,01 % |
| ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΠΡΑΞΕΩΝ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ | | | <u>2.384,13</u> | 0,01 % | 0,01 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΛΟΙΠΑ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ | | | <u>1.279.547,43</u> | 3,93 % | 4,11 % |
| ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ | | | | | |
| ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΨΕΩΣ | | | | | |
| ALPHA BANK EUR | | | <u>101.207,85</u> | 0,31 % | 0,32 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΨΕΩΣ | | | <u>101.207,85</u> | 0,31 % | 0,32 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΙΔΡΥΜΑΤΑ | | | <u>101.207,85</u> | 0,31 % | 0,32 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ | | | <u>32.553.188,94</u> | 100,00 % | 104,37 % |
| ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ | | | | | |
| ΠΙΣΤΩΤΕΣ ΔΙΑΦΟΡΟΙ | | | -1.273.243,93 | | -4,08 % |
| ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ ΑΠΟ ΦΟΡΟΥΣ | | | <u>-89.033,69</u> | | -0,29 % |
| ΣΥΝΟΛΟ ΣΕ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΑΘΗΤΙΚΟΥ | | | <u>-1.362.277,62</u> | | -4,37 % |
| ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ | | | <u>31.190.911,32</u> | | 100,00 % |
| ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ | | | | | |
| Αξία Καθαρού Ενεργητικού Χρήσεως 01.07.2023 - 30.06.2024 | | | 31.190.911,32 | | |
| Αριθμός Μεριδίων σε κυκλοφορία | | | 934.675,0000 | | |
| Τιμή Μεριδίου | | | 33,3709 | | |

ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΧΡΗΜΑΤΟΔΟΤΗΣΗΣ ΤΙΤΛΩΝ - ΑΝΟΙΚΤΕΣ ΘΕΣΕΙΣ ΤΗΝ 30.06.2024

| ΟΝΟΜΑ ΣΥΜΒΟΛΑΙΟΥ | Συνολική Ποσότητα Τεμαχίων (Δανεισμένων και μη) | Ποσότητα Τεμαχίων Δανεισμένων Μετοχών | Τρέχουσα Τιμή σε EUR | Τρέχουσα Αξία Δανεισμένων Τίτλων σε EUR | Ποσοστό % Αξίας Επί Συνόλου Δανεισμένων Μετοχών | Ποσοστό % Επί Συνολικής Ποσότητας Τεμαχίων | Ποσοστό % Αξίας Σ.Χ.Τ. Επί Κ.Ε. |
|------------------|---|---------------------------------------|----------------------|---|---|--|---------------------------------|
| EUROBBRA | 1.526.539 | 7.595 | 2,021 | 15.349,50 | 0,05% | 0,50% | 0,05 % |
| SARBRA | 17.052 | 500 | 10,800 | 5.400,00 | 0,02% | 2,93% | 0,02 % |
| Σύνολο | | 8.095 | | 20.749,50 | 0,07% | 3,43% | 0,07 % |
| EEESL | 99.407 | 4.904 | 31,500 | 154.476,00 | 0,50% | 4,93% | 0,50 % |
| SARSL | 17.052 | 341 | 10,800 | 3.682,80 | 0,01% | 2,00% | 0,01 % |
| Σύνολο | | 5.245 | | 158.158,80 | 0,51% | 6,93% | 0,51 % |

ΠΙΝΑΚΑΣ ΜΕΤΑΒΟΛΩΝ ΚΙΝΗΤΩΝ ΑΞΙΩΝ ΚΑΙ ΜΕΣΩΝ ΧΡΗΜΑΤΑΓΟΡΑΣ

ΜΕΤΑΞΥ 30.06.2024 ΚΑΙ 30.06.2023

(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 | 30.06.2023 | ΜΕΤΑΒΟΛΗ |
|--------------------------------|----------------------|----------------------|----------------|
| ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ | 31.190.911,32 | 28.105.958,88 | |
| ΚΙΝΗΤΕΣ ΑΞΙΕΣ | 99,94 % | 99,97 % | -0,03 % |
| ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΕ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΗ ΑΓΟΡΑ | | | |
| ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α | 85,64 % | 87,02 % | -1,38 % |
| ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ | | | |
| ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ ΣΤΟ Χ.Α | 14,30 % | 12,95 % | 1,35 % |

ΑΝΑΛΥΤΙΚΟΣ ΛΟΓΑΡΙΑΣΜΟΣ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ
ΧΡΗΣΕΩΣ 01.07.2023 - 30.06.2024

| | | ΑΞΙΑ ΣΕ EUR |
|---|-------------------|----------------------------|
| A. ΠΡΟΣΟΔΟΙ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ | | |
| I. Τόκοι Τραπεζικών Καταθέσεων | 410,04 | |
| II. Μερίσματα μετοχών εισηγμένων στο Χ.Α | 787.228,93 | |
| III. Μερίσματα Μετοχών εξωτερικού εισηγμένων στο Χ.Α. | <u>131.373,09</u> | |
| | | 919.012,06 |
| B. ΚΕΡΔΗ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ | | |
| I. Κέρδη από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων | 1.411.201,37 | |
| II. Ζημιές από πώληση Συμμετοχών και Χρεογράφων | -568.550,91 | |
| III. Έσοδα από δικαιώματα μετοχών εξωτερικού | <u>0,38</u> | |
| | | 842.650,84 |
| Γ. ΠΡΑΞΕΙΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ | | |
| I. Άμεσα έσοδα - Τόκοι Μεθόδου RA | 3.223,45 | |
| II. Άμεσα έξοδα - Προμήθειες μεθόδου RA | -313,16 | |
| III. Άμεσα έσοδα-τόκοι stock lending | 5.878,41 | |
| IV. Άμεσα έξοδα - Προμήθειες stock lending | <u>-823,01</u> | |
| | | 7.965,69 |
| Δ. ΕΣΟΔΑ ΚΑΙ ΕΞΟΔΑ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ | | |
| I. Έξοδα προηγούμενων χρήσεων | -101,75 | |
| | | -101,75 |
| ΣΤ. ΔΑΠΑΝΕΣ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗΣ | | |
| I. Αμοιβή Εταιρείας Διαχείρισης | -83.349,53 | |
| II. Αμοιβή Θεματοφυλακής | -30.308,84 | |
| III. Έξοδα Συμμετοχών και Χρεογράφων | -14.542,53 | |
| IV. Φόροι | -169.628,47 | |
| V. Τόκοι και Συναφή Έξοδα | -393,64 | |
| VI. Έξοδα άρθρου 9 του Κανονισμού | <u>-5.021,89</u> | |
| | | -303.244,90 |
| ΚΕΡΔΗ ΧΡΗΣΕΩΣ 01.07.2023 - 30.06.2024 | | <u>1.466.281,94</u> |

ΠΙΝΑΚΑΣ ΠΗΓΩΝ ΠΡΟΕΛΕΥΣΕΩΣ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ
ΚΑΙ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΑΠΟ 01.07.2023 - 30.06.2024 (Απόφαση Ε.Κ. 17/633/20.12.2012, άρθρο 4, παρ.2)

| | | ΜΕΡΙΔΙΑ | ΑΞΙΑ ΣΕ EUR |
|---|----------------------|---------------------------|-----------------------------|
| I. ΚΕΦΑΛΑΙΑ ΜΕΡΙΔΙΟΥΧΩΝ | | | |
| ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ | | | |
| Μερίδια σε κυκλοφορία την 30.06.2023 | | 906.928,000 | 24.548.268,00 |
| Πλέον Πωλήσεις μεριδίων 01.07.2023 - 30.06.2024 | | 27.747,000 | 904.914,22 |
| Μείον Εξαγορές μεριδίων 01.07.2023 - 30.06.2024 | | <u>0,000</u> | -1.261.811,25 |
| Κέρδη Χρήσεως 01.07.2023 - 30.06.2024 | | | <u>1.466.281,94</u> |
| Αξία Μεριδίων σε κυκλοφορία την 30.06.2024 ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ | | <u>934.675,000</u> | <u>25.657.652,91</u> |
| Συνολική Αξία Καθαρού Ενεργητικού σε αξίες κτήσεως την 30.06.2024 | | | <u>25.657.652,91</u> |
| II. ΔΙΑΦΟΡΕΣ ΑΠΟΤΙΜΗΣΗΣ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ | | | |
| α. Από Κινητές Αξίες / Μέσα Χρηματογαράς | | | |
| Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2024 | 25.639.175,25 | | |
| Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2024 | <u>31.172.433,66</u> | | |
| Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας) | | 5.533.258,41 | |
| β. Από Λοιπά Στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού | | | |
| Σε τιμές κτήσεως την 30.06.2024 | 18.477,66 | | |
| Σε τρέχουσες τιμές την 30.06.2024 | <u>18.477,66</u> | | |
| Σύνολο από λοιπά στοιχεία Ενεργητικού / Παθητικού | | <u>0,00</u> | |
| Σύνολο Υπεραξίας / (Υποαξίας) & Λοιπών Στοιχείων Ενεργητικού / Παθητικού | | | <u>5.533.258,41</u> |
| ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 30.06.2024 | | | <u>31.190.911,32</u> |

ΠΙΝΑΚΑΣ ΔΙΑΘΕΣΗΣ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ ΧΡΗΣΕΩΣ 01.07.2023 - 30.06.2024

| | | |
|-----------------------------------|--|---------------------|
| Καθαρά αποτελέσματα Κέρδη χρήσεως | | 1.466.281,94 |
| Κέρδη σε Κεφάλαιο | | <u>1.466.281,94</u> |

ΣΥΓΚΡΙΤΙΚΟΣ ΠΙΝΑΚΑΣ ΤΩΝ ΤΡΙΩΝ ΤΕΛΕΥΤΑΙΩΝ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΤΙΚΩΝ ΧΡΗΣΕΩΝ

| | ΧΡΗΣΗ 2024 | ΧΡΗΣΗ 2023 | ΧΡΗΣΗ 2022 |
|---|---------------|---------------|---------------|
| ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ | | | |
| ΚΑΘΑΡΗ ΑΞΙΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ 30.06 | 31.190.911,32 | 28.105.958,88 | 16.905.679,09 |
| ΑΡΙΘΜΟΣ ΜΕΡΙΔΙΩΝ 30.06 | 934.675,0000 | 906.928,0000 | 882.175,0000 |
| ΤΙΜΗ ΜΕΡΙΔΙΟΥ 30.06 | 33,3709 | 30,9903 | 19,1636 |

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 χρηματιστηρίου εταιρειών του ίδιου ομίλου αναλύονται ως εξής:

| ΟΜΙΛΟΣ/ΕΤΑΙΡΕΙΑ | ΑΞΙΑ ΣΕ ΕΥΡΟ | ΠΟΣΟΣΤΟ |
|---|---------------------|----------------|
| Eurobank Ergasias SA | 3.085.135,32 | 9,89 % |
| - Μετοχές | 3.085.135,32 | 9,89 % |
| National Bank of Greece SA | 3.088.986,99 | 9,90 % |
| - Μετοχές | 3.088.986,99 | 9,90 % |
| Alpha Services and Holdings SA | 2.323.541,65 | 7,45 % |
| - Μετοχές | 2.323.541,65 | 7,45 % |
| PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA | 2.541.393,71 | 8,15 % |
| - Μετοχές | 2.541.393,71 | 8,15 % |
| Athens Water Supply & Sewage Co SA | 165.276,80 | 0,53 % |
| - Μετοχές | 165.276,80 | 0,53 % |
| OPAP SA | 2.053.201,44 | 6,58 % |
| - Μετοχές | 2.053.201,44 | 6,58 % |
| Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA | 1.118.486,48 | 3,59 % |
| - Μετοχές | 1.118.486,48 | 3,59 % |
| Titan Cement Co SA | 890.984,25 | 2,86 % |
| - Μετοχές | 890.984,25 | 2,86 % |
| Viohalco SA | 512.365,84 | 1,64 % |
| - Μετοχές | 512.365,84 | 1,64 % |
| Ellaktor SA | 151.040,50 | 0,48 % |
| - Μετοχές | 151.040,50 | 0,48 % |
| Sarantis SA | 184.161,60 | 0,59 % |
| - Μετοχές | 184.161,60 | 0,59 % |
| GEK Terna Holding Real Estate Constructi | 1.555.772,92 | 4,99 % |
| - Μετοχές | 1.555.772,92 | 4,99 % |
| Mytilineos Holdings SA | 2.866.293,78 | 9,19 % |
| - Μετοχές | 2.866.293,78 | 9,19 % |
| JUMBO SA | 2.159.001,60 | 6,92 % |
| - Μετοχές | 2.159.001,60 | 6,92 % |
| Hellenic Telecommunications Organization | 1.838.390,40 | 5,89 % |
| - Μετοχές | 1.838.390,40 | 5,89 % |
| HELLENIQ ENERGY Holdings S.A | 504.816,00 | 1,62 % |
| - Μετοχές | 504.816,00 | 1,62 % |
| Public Power Corp SA | 1.752.383,44 | 5,62 % |
| - Μετοχές | 1.752.383,44 | 5,62 % |
| COCA COLA HBC AG | 3.131.320,50 | 10,04 % |
| - Μετοχές | 3.131.320,50 | 10,04 % |
| Consolidated Lamda Holdings SA | 416.713,98 | 1,34 % |
| - Μετοχές | 416.713,98 | 1,34 % |
| Main Stream S.A. | 160.744,00 | 0,52 % |
| - Μετοχές | 160.744,00 | 0,52 % |
| Athens International Airport SA | 325.853,50 | 1,04 % |
| - Μετοχές | 325.853,50 | 1,04 % |
| - Aegean Airlines SA | 346.568,96 | 1,11 % |
| - Μετοχές | 346.568,96 | 1,11 % |

ΛΟΙΠΕΣ ΓΝΩΣΤΟΠΟΙΗΣΕΙΣ

| | |
|---|-------------------------|
| ΜΕΘΟΔΟΣ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΕΚΘΕΣΗΣ ΣΕ ΚΙΝΔΥΝΟ | Σχετική αξία σε κίνδυνο |
| ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΑΝΑΦΟΡΑΣ | Δείκτης |
| MAX VAR | 101,2% |
| MIN VAR | 92,7% |
| AVERAGE VAR | 98,0% |
| ΕΠΙΠΕΔΟ ΜΟΧΛΕΥΣΗΣ 2024 (μέσος όρος) | 0,5% |
| ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ ΔΥΝΗΤΙΚΗΣ ΖΗΜΙΑΣ | Ιστορική Προσομοίωση |
| ΔΙΑΣΤΗΜΑ ΕΜΠΙΣΤΟΣΥΝΗΣ | 99% |
| ΠΕΡΙΟΔΟΣ ΔΙΑΚΡΑΤΗΣΗΣ | 1 μήνας |
| ΕΥΡΟΣ ΙΣΤΟΡΙΚΩΝ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ | 1έτος |

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 | 30.06.2023 | 30.06.2022 |
|--|----------------------|----------------------|----------------------|
| Μεταβιβάσιμοι Τίτλοι | 31.172.433,66 | 28.096.052,32 | 16.886.998,55 |
| Καταθέσεις σε τράπεζες | 101.207,85 | 260.551,21 | 75.825,51 |
| Λοιπά περιουσιακά στοιχεία | <u>1.279.547,43</u> | <u>407.267,23</u> | <u>443.492,33</u> |
| Σύνολο περιουσιακών στοιχείων | 32.553.188,94 | 28.763.870,76 | 17.406.316,39 |
| Υποχρεώσεις | <u>-1.362.277,62</u> | <u>-657.911,88</u> | <u>-500.637,30</u> |
| Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων | 31.190.911,32 | 28.105.958,88 | 16.905.679,09 |
| Αριθμός μονάδων (μεριδίων) σε κυκλοφορία | 934.675,000 | 906.928,000 | 882.175,000 |
| Αξία καθαρών περιουσιακών στοιχείων κατά μονάδα (μερίδια) | 33,3709 | 30,9903 | 19,1636 |
| Ανάλυση Χαρτοφυλακίου | | | |
| 1. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε επίσημο χρηματιστήριο αξιών | 31.172.433,66 | 28.096.052,32 | 16.886.998,55 |
| 2. Μεταβιβάσιμοι τίτλοι που διαπραγματεύονται σε άλλες ρυθμιζόμενες αγορές | 0,00 | 0,00 | 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 | <u>0,00</u> | <u>0,00</u> | <u>0,00</u> |
| Σύνολο | 31.172.433,66 | 28.096.052,32 | 16.886.998,55 |

II. ΚΑΤΑΣΤΑΣΗ ΕΞΕΛΙΞΗΣ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΠΕΡΙΟΥΣΙΑΚΩΝ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ Περίοδος 01.07.2023 έως 30.06.2024
 (N.4308/14 Παράρτημα Β. - Υπόδειγμα Β.12 / ΦΕΚ 251 Α/24-11-14)

| | 01.07.-30.06.24 | 01.01.-30.06.23 | 01.01.-30.06.22 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|
| A. Κατάσταση Αποτελεσμάτων Περιόδου | | | |
| Εισόδημα από επενδύσεις | 919.012,06 | 877.194,87 | 409.201,31 |
| Κέρδη / (Ζημιές) από αγοραπωλησίες κινητών αξιών / μέσων χρηματιστηρίου | 850.616,53 | 122.649,64 | -437.924,68 |
| Λοιπά εισοδήματα | -101,75 | 0,00 | 0,00 |
| Έξοδα διαχείρισης | -83.349,53 | -59.386,32 | -52.544,72 |
| Έξοδα θεματοφύλακα | -30.308,84 | -21.595,01 | -19.107,17 |
| Λοιπά έξοδα και φόροι | <u>-189.586,53</u> | <u>-81.591,22</u> | <u>-36.657,35</u> |
| Καθαρό εισόδημα | 1.466.281,94 | 837.271,96 | -137.032,61 |
| B. Κατάσταση λοιπών μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων περιόδου | | | |
| Διανομές και επανεπενδύσεις εισοδήματος | -1.261.811,25 | -562.295,36 | -458.731,00 |
| Έκδοση νέων μεριδίων | 904.914,22 | 454.781,92 | 601.492,51 |
| Διαφορές επιμέτρησης επενδύσεων | <u>1.975.567,53</u> | <u>10.470.521,27</u> | <u>-1.237.042,19</u> |
| Σύνολο | 1.618.670,50 | 10.363.007,83 | -1.094.280,68 |
| Σύνολο μεταβολών καθαρών περιουσιακών στοιχείων (A+B) | 3.084.952,44 | 11.200.279,79 | -1.231.313,29 |

ΣΗΜΕΙΩΣΕΙΣ

- Η σύνταξη της Κατάστασης Χρηματοοικονομικής Θέσης (Ισολογισμός) και η Κατάσταση Εξέλιξης των Καθαρών Περιουσιακών Στοιχείων περιόδου 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 μετοχών εταιρειών εσωτερικού και εξωτερικού εισηγμένων σε ενεργό αγορά, έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των τιμών κλεισίματος της 28.06.2024 (καθώς η 30.06.2024 ήταν αργία).
- Επενδυτικός σκοπός του Αμοιβαίου Κεφαλαίου είναι η αναπαραγωγή της απόδοσης, είτε θετικής είτε αρνητικής, του Δείκτη FTSE® / Athex Large Cap του Χρηματιστηρίου Αθηνών, ακολουθώντας πλήρως και πανομοιότυπες τη σύνθεσή του. Ο Δείκτης FTSE® / Athex Large Cap περιλαμβάνει 25 μετοχές εταιρειών εισηγμένων στο Χρηματιστήριο Αθηνών, όπως ορίζονται από τον οίκο FTSE Russell, με την ίδια στάθμιση που συμμετέχουν στο δείκτη. Το Αμοιβαίο Κεφάλαιο έχει εισαχθεί και διαπραγματεύεται στην Αγορά Αξιών του Χρηματιστηρίου Αθηνών, προσφέροντας την δυνατότητα στον επενδυτή να αποκτήσει μια διαφοροποιημένη έκθεση στην ελληνική μετοχική αγορά, με έναν ευέλικτο και χαμηλού κόστους τρόπο.
- Οι καταθέσεις όψεως 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 όψεως έως και την 30.06.2024, περιλαμβάνονται στα έσοδα της χρήσεως 01.07.2023 - 30.06.2024. Το σύνολο το χρηματικών διαθεσίμων τηρείται σε υποκατάστημα της Alpha Bank και το ποσοστό αυτού δεν υπερβαίνει το 20% σύμφωνα με το άρθρο 61 περ.2.
- Στην διάρκεια της χρήσεως 01.07.2023 - 30.06.2024, 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.
- Στον πίνακα προέλευσης καθαρού ενεργητικού και αποτελεσμάτων από 01.07.2023 - 30.06.2024 η αξία των μεριδίων 30.06.2023 εμφανίζεται σε κόστος κτήσεως.
- Η αποτίμηση των μετοχών εταιρειών εσωτερικού που χρησιμοποιήθηκαν για την σύναψη συμβάσεων επαναγοράς (RA) και παρουσιάζονται στην αναλυτική περιουσιακή κατάσταση, έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των τιμών κλεισίματος της 28.06.2024 (καθώς η 30.06.2024 ήταν αργία). Τα έσοδα (τόκοι) και τα έξοδα (προμήθειες), που προέκυψαν από τις συναλλαγές δανεισμού ανέρχονται σε EUR 3.223,45 και EUR 313,16 αντίστοιχα, καταχωρήθηκαν δε στα έσοδα και έξοδα της χρήσεως 01.07.2023 έως 30.06.2024. Η αξία των Σ.Χ.Τ. ανέρχεται σε EUR 20.749,50, τα δε ποσοστά επί της αξίας του συνόλου των δανείσμων περιουσιακών στοιχείων (εκτός ταμειακών διαθεσίμων και ισοδυνάμων) και των υπό διαχείριση περιουσιακών στοιχείων ανέρχονται σε 0,07% και 0,07% αντίστοιχα. Οι συγκεκριμένες Συναλλαγές Χρηματοδότησης Τίτλων διενεργούνται στην Αγορά Παραγώγων του Χ.Α. κι έτσι η εκκαθάριση διενεργείται από την ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟΥ ΑΘΗΝΩΝ Α.Ε. που έχει το ρόλο του Κεντρικού Αντισυμβαλλόμενου. Αφορούν σε ανοιχτές συναλλαγές Ελλάδος για τις οποίες δεν υπήρξε εισπραχθεί ασφάλεια (ρήτρα). (Κανονισμός Ε/Ε/2015/2365 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 25.11.15 περί διαφάνειας των συναλλαγών χρηματοδότησης τίτλων και επαναχρησιμοποίησης και περί τροποποίησης του Κανονισμού Ε.Ε. αρ.648/2012). (Τεχνικές Αποτελεσματικές Διαχειρίσεις Χαρτοφυλακίου-Αποφ. Ε.Κ.3/645/2013 και αρ.12 Αποφ.Ε.Κ.10/773/2016).

8. Η αποτίμηση των μετοχών εταιρειών εσωτερικού που χρησιμοποιήθηκαν για την σύναψη συμβάσεων επαναγοράς Stock Lending και παρουσιάζονται στην αναλυτική περιουσιακή κατάσταση, έγινε στην εύλογη αξία τους βάσει των τιμών κλεισίματος της 28.06.2024 (καθώς η 30.06.2024 ήταν αργία). Τα έσοδα (τόκοι) και τα έξοδα (προμήθειες), που προέκυψαν από τις συναλλαγές δανεισμού ανέρχονται σε EUR 5.878,41 και EUR 823,01 αντίστοιχα, καταχωρήθηκαν δε στα έσοδα και έξοδα της χρήσεως 01.07.2023 έως 30.06.2024. Η αξία των Σ.Χ.Τ. ανέρχεται σε EUR 158.158,80, τα δε ποσοστά επί της αξίας του συνόλου των δανείσιμων περιουσιακών στοιχείων (εκτός ταμειακών διαθεσίμων και ισοδυνάμων) και των υπό διαχείριση περιουσιακών στοιχείων ανέρχονται σε 0,51% και 0,51% αντίστοιχα. Οι συγκεκριμένες Συναλλαγές Χρηματοδότησης Τίτλων διενεργούνται στην Αγορά Παραγών του Χ.Α. κι έτσι η εκκαθάριση διενεργείται από την ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΕΚΚΑΘΑΡΙΣΗΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟΥ ΑΘΗΝΩΝ Α.Ε. που έχει το ρόλο του Κεντρικού Αντισυμβαλλόμενου. Αφορούν σε ανοιχτές συναλλαγές Ελλάδος για τις οποίες δεν υπήρξε είσπραξη ασφάλειας (ρήτρα). (Κανονισμός Ε/Ε/2015/2365 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 25.11.15 περί διαφάνειας των συναλλαγών χρηματοδότησης τίτλων και επαναχρησιμοποίησης και περί τροποποίησης του Κανονισμού Ε.Ε. αρ.648/2012). (Τεχνικές Αποτελεσματικής Διαχείρισης Χαρτοφυλακίου-Αποφ. Ε.Κ.3/645/2013 και αρ.12 Αποφ.Ε.Κ.10/773/2016).

9. 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 και 65 του Ν.4099/2012.

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

| | Κατηγορία 1 | Κατηγορία 2 | Κατηγορία 3 | Σύνολο |
|---------------|----------------------|-------------|-------------|----------------------|
| Μετοχές | 31.172.433,66 | - | - | 31.172.433,66 |
| Σύνολο | 31.172.433,66 | - | - | 31.172.433,66 |

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.

11. Κατά τη διάρκεια της διαχειριστικής χρήσης 01.07.2023 έως 30.06.2024, η συνολική απόδοση του Αμοιβαίου Κεφαλαίου διαμορφώθηκε σε +12,04%, με την απόδοση του δείκτη αναφοράς FTSE/Athex Large Cap να ανέρχεται σε +9,78%.

Το επενδυμένο ποσοστό του Αμοιβαίου Κεφαλαίου σε μετοχές εισηγμένες στο Χ.Α. κυμάνθηκε κατά μέσο όρο στα επίπεδα του 99,8% κατά τη διάρκεια του έτους. Ειδικότερα, το ενεργητικό του Αμοιβαίου Κεφαλαίου επενδύθηκε στις εισηγμένες στο Χ.Α. μετοχές που απαρτίζουν το δείκτη FTSE/Athex Large Cap, με την ίδια στάθμιση που συμμετέχουν στο δείκτη. Παρακολουθώντας τις ανακοινώσεις του Χ.Α. περί αναθεώρησης του δείκτη, το Α/Κ προέβη σε αναδιαρθρώσεις του χαρτοφυλακίου του κατά την ίδια χρονική στιγμή ισχύος των αλλαγών του υποκείμενου δείκτη.

Κατά τη διαχειριστική χρήση (01.07.2023-30.06.2024) το «ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ» προχώρησε σε επιστροφή κεφαλαίου στους κατόχους μεριδίων του. Συγκεκριμένα, στις 30 Ιουνίου 2024 η Διαχειρίτρια Εταιρεία προχώρησε σε επιστροφή κεφαλαίου με επανένδυση σε μερίδια του «ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap Μετοχικός ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ». Το συνολικό ποσό της επιστροφής κεφαλαίου, όπως αυτό προσδιορίζεται με την ολοκλήρωση της αποτίμησης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου της 30.6.2024, ανήλθε σε Ευρώ 1.261.811,25, ήτοι Ευρώ 1,35 ανά μερίδιο για τους κατόχους μεριδίων του «ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ» κατά την ημερομηνία προσδιορισμού δικαιούχων (record date) 02.07.2024. Η επανένδυση του ποσού της επιστροφής κεφαλαίου πραγματοποιήθηκε με την τιμή μεριδίου του Αμοιβαίου Κεφαλαίου που προέκυψε από την αποτίμηση της 03.07.2024, ήτοι 34,0201. Η αναλογία νέων προς παλιά μερίδια ήταν για κάθε ένα (1) παλαιό μερίδιο προς 0,03968242 νέα μερίδια. Από την 04.07.2024, το νέο σύνολο εισηγμένων μεριδίων της Εταιρείας στο Χρηματιστήριο Αθηνών ανήλθε σε 971.502.

Κατά τη διαχειριστική χρήση (01.07.2023 - 30.06.2024) το σφάλμα παρακολούθησης μεταξύ της απόδοσης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου και της απόδοσης του δείκτη αναφοράς, λαμβάνοντας υπόψη εβδομαδιαίες παρατηρήσεις, διαμορφώθηκε στο 1,00% έναντι 1,15% αναμενόμενου σφάλματος παρακολούθησης, το οποίο βασίζεται στο πραγματοποιηθέν σφάλμα παρακολούθησης της προηγούμενης διαχειριστικής χρήσης (01.07.2022 -30.06.2023). Η απόκλιση οφείλεται στο χρονισμό της αποκοπής των μερισμάτων των εταιριών που απαρτίζουν το χαρτοφυλάκιο.

Επίσης, για τη διαχειριστική χρήση (01.07.2023 -30.06.2024) παρατηρήθηκε μια περίπτωση υπέρβασης του μέγιστου ποσοστού απόκλισης +/-3% μεταξύ της τιμής του μεριδίου που διαμορφώνεται στην οργανωμένη αγορά σε σχέση με την ενδεικτική καθαρή τιμή του μεριδίου. Συγκεκριμένα στις 30.06.2024 η απόκλιση διαμορφώθηκε σε +4,49 %, ως αποτέλεσμα της αποκοπής μερίσματος.

12. Σύμφωνα με το Αρθ.1, παρ.ΙΙ 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).

| 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 ενοποιημένη 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 24.10.2024

Ο Θεματοφύλακας
ALPHA BANK

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

Α.Ν. ΑΡΟΤΣΙΔΟΥ

Ε.Α. ΓΡΥΠΛΑΙΟΥ

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 ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ”

Έκθεση Ελέγχου επί της Ετήσιας Έκθεσης Διαχείρισης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ”

Γνώμη

Έχουμε ελέγξει την Ετήσια Έκθεση Διαχείρισης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ” (η Έκθεση Διαχείρισης) της 30^{ης} Ιουνίου 2024, που καταρτίστηκε από την διαχειριζόμενη την περιουσία του “ΑΛΦΑ ASSET MANAGEMENT ΜΟΝΟΠΡΟΣΩΠΗ ΑΝΩΝΥΜΗ ΕΤΑΙΡΕΙΑ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΕΩΣ ΑΜΟΙΒΑΙΩΝ ΚΕΦΑΛΑΙΩΝ ” (η Διαχειρίστρια Εταιρεία) η οποία περιλαμβάνει την κατάσταση χρηματοοικονομικής θέσης, την κατάσταση εξέλιξης των καθαρών περιουσιακών στοιχείων χρήσης, καθώς και τις λουπές πληροφορίες, τα στοιχεία και τις σημειώσεις του Αμοιβαίου Κεφαλαίου.

Κατά τη γνώμη μας, η συνημμένη Έκθεση Διαχείρισης έχει καταρτιστεί από κάθε ουσιώδη άποψη σύμφωνα με τις σχετικές διατάξεις του Ν. 4308/2014, περιλαμβάνοντας τις πληροφορίες και τα στοιχεία 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.

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 ενότητα της έκθεσής μας “Ευθύνες ελεγκτή για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχείρισης”. Είμαστε ανεξάρτητοι από την Διαχειρίστρια Εταιρεία και από το διαχειριζόμενο από αυτή Αμοιβαίο Κεφάλαιο καθόλη 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 των οικονομικών καταστάσεων 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.

Σημαντικότερα θέματα ελέγχου

Τα σημαντικότερα θέματα ελέγχου είναι εκείνα τα θέματα που, κατά την επαγγελματική μας κρίση, ήταν εξέχουσας σημασίας στον έλεγχό μας επί της Έκθεσης Διαχείρισης του Αμοιβαίου Κεφαλαίου της χρήσης. Στην τρέχουσα χρήση δεν έχουμε αναγνωρίσει σημαντικά θέματα ελέγχου προς γνωστοποίηση στην έκθεσή μας.

Ευθύνες της διοίκησης της Διαχειρίστριας Εταιρείας επί της Έκθεσης Διαχειρίσεως

Η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας έχει την ευθύνη για την κατάρτιση της Έκθεσης Διαχειρίσεως, 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 και για εκείνες τις δικλίδες εσωτερικού ελέγχου που η διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας καθορίζει ως απαραίτητες, ώστε να καθίσταται δυνατή η κατάρτιση Έκθεσης Διαχειρίσεως, 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 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, 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 εσωτερικών δικλίδων ελέγχου.
- Αποκτούμε κατανόηση των δικλίδων εσωτερικού ελέγχου που σχετίζονται με τον έλεγχο, με σκοπό το σχεδιασμό ελεγκτικών διαδικασιών κατάλληλων για τις περιστάσεις, αλλά όχι με σκοπό τη διατύπωση γνώμης επί της αποτελεσματικότητας των δικλίδων εσωτερικού ελέγχου της Διαχειρίστριας Εταιρείας.
- Αξιολογούμε την καταλληλότητα των λογιστικών πολιτικών 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.
- Συλλέγουμε επαρκή και κατάλληλα ελεγκτικά τεκμήρια αναφορικά με την χρηματοοικονομική πληροφόρηση για την έκφραση γνώμης επί της Έκθεσης Διαχειρίσεως. Είμαστε υπεύθυνοι για την καθοδήγηση, την επίβλεψη και την εκτέλεση του ελέγχου του Αμοιβαίου Κεφαλαίου. Παραμένουμε αποκλειστικά υπεύθυνοι για την ελεγκτική μας γνώμη.

Μεταξύ άλλων θεμάτων, κοινοποιούμε στην διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας 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. Επιπλέον, δηλώνουμε στην διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας ότι έχουμε συμμορφωθεί με τις σχετικές απαιτήσεις δεοντολογίας περί ανεξαρτησίας και γνωστοποιούμε προς αυτή όλες τις σχέσεις και άλλα θέματα που μπορεί εύλογα να θεωρηθεί ότι επηρεάζουν την ανεξαρτησία μας και τα σχετικά μέτρα προστασίας, όπου συντρέχει περίπτωση.

Από τα θέματα που γνωστοποιήθηκαν στην διοίκηση της Διαχειρίστριας Εταιρείας, καθορίζουμε τα θέματα εκείνα που ήταν εξέχουσας σημασίας για τον έλεγχο της Έκθεσης Διαχειρίσεως της τρέχουσας χρήσης και ως εκ τούτου αποτελούν τα σημαντικότερα θέματα ελέγχου.

Έκθεση επί άλλων Νομικών και Κανονιστικών Απαιτήσεων

1. Παροχή μη ελεγκτικών υπηρεσιών

Δεν παρείχαμε στην Διαχειρίστρια Εταιρεία και στο Αμοιβαίο Κεφάλαιο “ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ” μη ελεγκτικές υπηρεσίες που απαγορεύονται σύμφωνα με το άρθρο 5 του κανονισμού της Ευρωπαϊκής Ένωσης (ΕΕ) αριθ. 537/2014 ή λοιπές επιτρεπόμενες μη ελεγκτικές υπηρεσίες.

2. Διορισμός ελεγκτή

Διοριστήκαμε για πρώτη φορά ως Ορκωτοί Ελεγκτές Λογιστές του Αμοιβαίου Κεφαλαίου “ALPHA ETF FTSE Athex Large Cap ΜΕΤΟΧΙΚΟΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΣ ΟΣΕΚΑ” με την από 25.07.2022 απόφαση της ετήσιας τακτικής γενικής συνέλευσης των μετόχων της Διαχειρίστριας Εταιρείας και επαναδιοριστήκαμε από την τακτική γενική συνέλευση της Διαχειρίστριας Εταιρείας με την από 31.07.2024 απόφασή της.

Αθήνα, 30 Οκτωβρίου 2024

Η Ορκωτός Ελεγκτής Λογιστής

Φωτεινή Δ. Γιαννοπούλου

Α.Μ. ΣΟΕΛ: 24031

Deloitte Ανώνυμη Εταιρία Ορκωτών Ελεγκτών Λογιστών
Φραγκοκκλησιάς 3α & Γρανικού,
151 25 Μαρούσι
Α.Μ. ΣΟΕΛ: Ε 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.