

ATTICA DYNAMIC ASSET ALLOCATION FUND OF FUNDS ΜΙΚΤΟ *
ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ ΤΗΣ 30/03/2012
Α Τρίμηνο 2012

Σύνθεση Ενεργητικού Αμοιβαίου Κεφαλαίου	Κωδικός ISIN	Πρόσθετοι Ουσιώδεις Όροι	Πιστοληπτική Διαβάθμιση (1)	Τεμάχια	Τιμή Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου (2)	Συνολική Αξία Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου
I ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
1 Διαθέσιμα - Καταθέσεις						
ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΥΡΩΣ ΕΤΕ						0,11
ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ ΟΥΡΩΣ HSBC						16.815,22
ΠΡΟΘΕΣΜΙΑΚΗ ΚΑΤΑΘΕΣΗ 21/03-20/04/12, ΠΕΙΡΑΙΩΣ						101.679,86
ΠΡΟΘΕΣΜΙΑΚΗ ΚΑΤΑΘΕΣΗ 29/03-05/04/12, ΠΕΙΡΑΙΩΣ						100.262,80
ΠΡΟΘΕΣΜΙΑΚΗ ΚΑΤΑΘΕΣΗ 30/03-03/04/12, ΑΤΤΙΣΑ						328.887,58
Σύνολο I.1.						547.645,57
2 Μέσα Χρηματαγοράς						
Σύνολο I.2.						0,00
3 Ομολογίες - ΕΓΕΑ						
ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ ΚΥΜΑΝΟΥ ΕΠΙΤΟΚΙΟΥ						
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/23, 2,00%	GR0128010676		Composite CCC+	202,50	23,89	4.837,73
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/23, 2,00%						18,81
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/24, 2,00%	GR0128011682		Composite CCC+	202,50	22,48	4.552,20
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/24, 2,00%						18,81
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/25, 2,00%	GR0128012698		Composite CCC+	202,50	21,80	4.414,50
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/25, 2,00%						18,81
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/26, 2,00%	GR0128013704		Composite CCC+	202,50	20,84	4.220,10
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/26, 2,00%						18,81
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/27, 2,00%	GR0128014710		Composite CCC+	202,50	19,52	3.952,80
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/27, 2,00%						18,81
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/28, 2,00%	GR0133006198		Composite CCC+	216,00	18,80	4.060,80
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/28, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/29, 2,00%	GR0133007204		Composite CCC+	216,00	19,05	4.114,80
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/29, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/30, 2,00%	GR0133008210		Composite CCC+	216,00	18,91	4.084,56
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/30, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/31, 2,00%	GR0133009226		Composite CCC+	216,00	18,96	4.095,36
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/31, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/32, 2,00%	GR0133010232		Composite CCC+	216,00	18,52	4.000,32
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/32, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/33, 2,00%	GR0138005716		Composite CCC+	216,00	17,85	3.855,60
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/33, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/34, 2,00%	GR0138006722		Composite CCC+	216,00	18,11	3.911,76
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/34, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/35, 2,00%	GR0138007738		Composite CCC+	216,00	17,48	3.775,68
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/35, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/36, 2,00%	GR0138008744		Composite CCC+	216,00	18,10	3.909,60
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/36, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/37, 2,00%	GR0138009759		Composite CCC+	216,00	18,05	3.898,80
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/37, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/38, 2,00%	GR0138010765		Composite CCC+	216,00	18,02	3.892,32
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/38, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/39, 2,00%	GR0138011771		Composite CCC+	216,00	17,07	3.687,12
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/39, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/40, 2,00%	GR0138012787		Composite CCC+	216,00	17,78	3.840,48
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/40, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/41, 2,00%	GR0138013793		Composite CCC+	216,00	18,08	3.905,28
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/41, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/42, 2,00%	GR0138014809		Composite CCC+	216,00	18,65	4.028,40
Κ.Τ. ΟΕΑ 24/02/12- 24/02/42, 2,00%						20,07
ΟΕΑ 24/02/12- 15/10/42	GRR0000000010		S&P CCC	4.252,00	0,35	1.488,20
Σύνολο I.3.						82.921,51
4 Μετοχές						
Μετοχές Εισηγμένες στο ΧΑΑ						
ΑΤΤΙΣΑ BANK Α.Τ.Ε. (ΚΟ)	GRS001013002			42.416,00	0,224	9.501,18
ΑΕΤ ΤΙΤΑΝ (ΚΟ)	GRS074083007			374,00	13,850	5.179,90
FRIGOGLOSS ΑΕ (ΚΟ)	GRS346153000			461,00	4,920	2.268,12
Σύνολο						16.949,20
Μετοχές μη Εισηγμένες						
Σύνολο						0,00
Σύνολο I.4.						16.949,20
5 Αμοιβαία Κεφάλαια						
Σύνολο I.5.						0,00
6 Λοιποί Οργανισμοί Συλλογικών Επενδύσεων						
Σύνολο I.6.						0,00
Σύνολο Επενδύσεων Εσωτερικού (I)						647.516,28
II ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ						
1 Διαθέσιμα - Καταθέσεις						
Σύνολο II.1.						0,00
2 Μέσα Χρηματαγοράς						
Σύνολο II.2.						0,00
3 Ομολογίες						
ΣΤΑΘΕΡΟΥ ΕΠΙΤΟΚΙΟΥ						
ΕFSF 12/03/12- 12/03/13, 0,40%	EU000A1G0AF5		Composite AA+	1.012,50	99,70	100.946,25
ΕFSF 12/03/12- 12/03/14, 1,00%	EU000A1G0AG3		Composite AA+	1.012,50	99,84	101.088,00
Σύνολο II.3.						202.034,25
4 Μετοχές						
Μετοχές Εισηγμένες						
Σύνολο						0,00
Μετοχές μη Εισηγμένες						
Σύνολο						0,00
Σύνολο II.4.						0,00
5 Αμοιβαία Κεφάλαια						
Σύνολο II.5.						0,00
6 Λοιποί Οργανισμοί Συλλογικών Επενδύσεων						
Σύνολο II.6.						0,00
Σύνολο Επενδύσεων Εξωτερικού (II)						202.034,25
ΣΥΝΟΛΟ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)						849.550,53
Απαιτήσεις - Υποχρεώσεις						
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ						1.798.895,72

Σύνθεση Ενεργητικού Αμοibaίου Κεφαλαίου	Κωδικός ISIN	Πρόσθετοι Ουσιώδεις Όροι	Πιστοληπτική Διαβάθμιση	Τεμάχια	Τιμή Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου	Συνολική Αξία Τελευταίας Ημέρας Τριμήνου
III ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ						
1 Futures (ΣΜΕ) (2)						
Σύνολο III.1.						
2 Options (3)						
Σύνολο III.2.						
3 Warrants						
Σύνολο III.3.						
4 Stock Repos						
Σύνολο III.4.						
5 Forwards						
Σύνολο III.5.						
6 Λοιπά Παράγωγα						
Σύνολο III.6.						
Σύνολο Επενδύσεων σε Παράγωγα Εσωτερικού (III)						
IV ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)						
1 Futures (ΣΜΕ) (2)						
Σύνολο IV.1.						
2 Options (3)						
Σύνολο IV.2.						
3 Warrants						
Σύνολο IV.3.						
4 Stock Repos						
Σύνολο IV.4.						
5 Forwards						
Σύνολο IV.5.						
6 Λοιπά Παράγωγα						
Σύνολο IV.6.						
Σύνολο Επενδύσεων σε Παράγωγα Εξωτερικού (IV)						
ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ (III)+(IV)						

* Αλλαγή επωνυμίας και κατηγορίας από το ΑΤΤΙΚΗΣ ΜΙΚΤΟ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ 27/03/2012

Σημείωση : 1. Η εταιρία χρησιμοποιεί την συνδυαστική βαθμολόγηση πιστοληπτικής ικανότητας του Bloomberg (bloomberg composite) που προκύπτει από τον συνδυασμό πιστοληπτικών διαβαθμίσεων των επιμέρους οίκων πιστοληπτικής αξιολόγησης (Moody's,S&P, κλπ), για κάθε Ομολογία. Οπου αυτό δεν είναι διαθέσιμο χρησιμοποιεί την διαθέσιμη από κάθε οίκο πιστοληπτική διαβάθμιση (Moody's,S&P κλπ).

2. Η αποτίμηση των Ο.Ε.Δ. έγινε με βάση το Δελτίο Τιμών Αγοράς Τίτλων Ελληνικού Δημοσίου της 30/03/2012 της Η.Δ.Α.Τ. (Ηλεκτρονική Δευτερογενής Αγορά Τίτλων)

Τα Ομόλογα Εξωτερικού καθώς και οι Ομολογίες Ελλήνων Εκδοτών που διαπραγματεύονται σε Χρηματιστήρια του εξωτερικού αποτιμήθηκαν στην εύλογη αξία τους, που κατά περίπτωση ήταν η τιμή που προέκυψε από: i) την τελευταία διαθέσιμη μέση τιμή ζήτησης (BGN ή CBBT), ii) τη σταθμισμένη τιμή ζήτησης των παρόχων, iii) την τιμή ζήτησης του Lead Manager της έκδοσής τους, κατά την 30/03/2012 - (Πηγή Αποτίμησης Bloomberg).

Στην περίπτωση ομολόγου για το οποίο δεν υπάρχει ενεργός αγορά, η εύλογη αξία του καθορίζεται με τη χρήση τεχνικής επιμέτρησης που χρησιμοποιεί η εταιρία και η οποία βασίζεται στην μέθοδο αναφοράς στην τρέχουσα εύλογη αξία ενός ομοειδούς συναφούς μέσου.

Αθήνα, 10/04/2012

ΑΤΤΙΚΑ WEALTH MANAGEMENT ΑΕΔΑΚ

Θ. ΚΡΙΝΤΑΣ

Γ. ΠΑΖΙΩΤΟΠΟΥΛΟΣ