

## קופ"ג תע"א-גיל 60-50 מספר אישור 9892

דוח חודשי לחודש 9/2020

### דו"ח נכסים ותזרים מנכסים

נכסים  
סכום באלפי ש"ח

5,490.660  
7,904.184  
48,770.844

154,031.355

243,974.665  
3,193.333

4,200.261

#### א. מזומנים ושווי מזומנים

##### בישראל

מזומן בש"ח

מזומן מט"ח

פרי / פחק

פקדון לתקופה של עד שלושה חודשים

פקדון צמוד מדד לתקופה של עד שלושה חודשים

פקדון צמוד מט"ח לתקופה של עד שלושה חודשים

פקדון במט"ח לתקופה של עד שלושה חודשים

##### בחו"ל

מזומן מט"ח

פקדון לתקופה של עד שלושה חודשים בחו"ל

#### ב. ניירות ערך

##### 1. אגרות חוב ממשלתיות

###### בישראל - סחיר

ממשלתי צמוד

ממשלתי צמוד מט"ח

ממשלתי לא צמוד קבוע

ממשלתי לא צמוד משתנה

מק"מ

###### בישראל - לא סחיר

אג"ח מיעדות

פקדונות חשכל

###### בחו"ל - סחיר

ממשלתי בחו"ל

ממשלתי זר בחו"ל

###### בחו"ל - לא סחיר

ממשלתי לא סחיר בחו"ל

ממשלתי זר לא סחיר בחו"ל

#### תעודות חוב מסחריות

##### בישראל - סחיר

תעודות חוב צמוד מדד בדרוג AA- ומעלה

תעודות חוב צמוד מט"ח בדרוג AA- ומעלה

תעודות חוב לא צמוד בדרוג AA- ומעלה

תעודות חוב צמוד מדד בדרוג A+:BBB-

תעודות חוב צמוד מט"ח בדרוג A+:BBB-

תעודות חוב לא צמוד בדרוג A+:BBB-

תעודות חוב צמוד מדד בדרוג בדרוג נמוך

תעודות חוב צמוד מט"ח בדרוג בדרוג נמוך

תעודות חוב לא צמוד בדרוג בדרוג נמוך

##### בישראל - לא סחיר

תעודות חוב ל"ס צמוד מדד AA- ומעלה

תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח AA- ומעלה

תעודות חוב ל"ס לא צמוד AA- ומעלה

תעודות חוב ל"ס צמוד מדד A+:BBB-

תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח A+:BBB-

תעודות חוב ל"ס לא צמוד A+:BBB-

תעודות חוב ל"ס צמוד מדד דרוג נמוך עם בטוחה מספקת  
תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך עם בטוחה מספקת  
תעודות חוב ל"ס לא צמוד דרוג נמוך עם בטוחה מספקת  
תעודות חוב ל"ס צמוד מדד דרוג נמוך  
תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך  
תעודות חוב ל"ס לא צמוד דרוג נמוך

**בח"ל - סחיר**

תעודות חוב סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה חברות ישראליות  
תעודות חוב סחירות בחו"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות ישראליות  
תעודות חוב סחירות בחו"ל בדירוג נמוך חברות ישראליות  
תעודות חוב סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה חברות זרות  
תעודות חוב סחירות בחו"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות זרות  
תעודות חוב סחירות בחו"ל בדירוג נמוך חברות זרות

**בח"ל - לא סחיר**

תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה חברות ישראליות  
תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות ישראליות  
תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך עם בטוחה מספקת חברות ישראליות  
תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך חברות ישראליות  
תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה חברות זרות  
תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות זרות  
תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך עם בטוחה מספקת חברות זרות  
תעודות חוב לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך חברות זרות

**3. אגרות חוב קונצרניות סחירות**

**בישראל - סחיר**

115,381.932 אג"ח קונצרני צמוד מדד בדרוג AA- ומעלה  
1,314.782 אג"ח קונצרני צמוד מט"ח בדרוג AA- ומעלה  
53,109.088 אג"ח קונצרני לא צמוד בדרוג AA- ומעלה  
6,365.519 אג"ח קונצרני אחרות בדרוג AA- ומעלה  
4,964.958 אג"ח קונצרני צמוד מדד בדרוג A+:BBB-  
55,516.615 אג"ח קונצרני צמוד מט"ח בדרוג A+:BBB-  
2,306.229 אג"ח קונצרני לא צמוד בדרוג A+:BBB-  
1,689.712 אג"ח קונצרני אחרות בדרוג A+:BBB-  
6,194.616 אג"ח קונצרני אחרות בדרוג A+:BBB-  
אג"ח קונצרני צמוד מדד בדרוג נמוך  
אג"ח קונצרני צמוד מט"ח בדרוג נמוך  
אג"ח קונצרני לא צמוד בדרוג נמוך  
אג"ח קונצרני אחרות בדרוג נמוך

**בישראל - לא סחיר**

2,127.173 אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מדד AA- ומעלה  
4,931.656 אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מט"ח AA- ומעלה  
5,058.084 אג"ח קונצרני ל"ס לא צמוד AA- ומעלה  
2,045.952 אג"ח קונצרני ל"ס אחרות AA- ומעלה  
אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מדד בדרוג נמוך עם בטוחה מספקת  
אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך עם בטוחה מספקת  
אג"ח קונצרני ל"ס לא צמוד דרוג נמוך עם בטוחה מספקת  
אג"ח קונצרני ל"ס אחרות דרוג נמוך עם בטוחה מספקת  
אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מדד דרוג נמוך  
אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך  
אג"ח קונצרני ל"ס לא צמוד דרוג נמוך  
אג"ח קונצרני ל"ס אחרות דרוג נמוך

**בח"ל - סחיר**

3,484.959 אג"ח ישראליות סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה  
אג"ח ישראליות סחירות בחו"ל בדירוג BBB+:-BBB נמוך  
אג"ח זרות סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה  
4,663.820 אג"ח זרות סחירות בחו"ל בדירוג BBB+:-BBB  
2,047.673 אג"ח זרות סחירות בחו"ל בדירוג נמוך

**בח"ל - לא סחיר**

אג"ח ישראליות לא סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה

אג"ח ישראליות לא סחירות בחו"ל בדירוג BBB:-BBB+  
 אג"ח ישראליות לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך עם בטוחה מספקת  
 אג"ח ישראליות לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך  
 אג"ח זרות לא סחירות בחו"ל בדירוג A- ומעלה  
 אג"ח זרות לא סחירות בחו"ל בדירוג BBB:-BBB+  
 אג"ח זרות לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך עם בטוחה מספקת  
 אג"ח זרות לא סחירות בחו"ל בדירוג נמוך

**4. מניות**

**בישראל - סחירות**

מניות במדד ת"א 35 109,645.778  
 מניות במדד ת"א 90 51,203.055  
 מניות היתר 14,847.359  
 מניות זרות הנסחרות בארץ 869.610

אופציות call 1 (long)  
 אופציות call 1 (short)

**בישראל - לא סחירות**

מניות לא סחירות בארץ 1,257.829

**בחו"ל - סחירות**

מניות ישראליות בחו"ל 1,674.221  
 מניות של תאגיד תושב חוץ החזקה עד 10% 107,323.422  
 מניות של תאגיד תושב חוץ החזקה של 10% ומעלה

**בחול - לא סחירות**

מניות ל"ס של חברות ישראליות 349.262  
 מניות ל"ס של חברות זרות

**5. השקעה בקרנות סל**

**נסחרות בישראל**

השקעה בקרנות סל שעוקבות אחר מדדי מניות בארץ 1,215.732  
 השקעה בקרנות סל שעוקבות אחר מדדי מניות בחול 47,032.187  
 השקעה בקרנות סל שעוקבות אחר מדדי אג"ח בארץ 6,114.862  
 השקעה בקרנות סל שעוקבות אחר מדדי אג"ח בחול  
 השקעה בקרנות סל בחסר או תעודות פיקדון בחסר בארץ  
 השקעה בקרנות סל אחרות

**נסחרות בחו"ל**

השקעה בקרנות סל שנסחרות בחו"ל שעוקבות אחר מדדי מניות 232,659.400  
 השקעה בקרנות סל שנסחרות בחו"ל שעוקבות אחר מדדי אג"ח 4,993.889  
 השקעה בקרנות סל בחסר בחו"ל  
 השקעה בקרנות סל אחרות

**6. קרנות נאמנות**

**בישראל**

תעודות השתתפות בקרן נאמנות 11,404.414  
 תעודות השתתפות בקרן נאמנות - אג"ח קונצרני  
 תעודות השתתפות בקרן נאמנות - אג"ח ממשלתי 10,331.870  
 תעודות השתתפות בקרן נאמנות - מניות  
 תעודות השתתפות בקרן נאמנות - אחר

**7. השקעה בקרנות**

**בישראל**

קרנות הון סיכון 104,934.341  
 קרנות נדלן  
 קרנות גידור  
 קרנות השקעה אחרות

**בחו"ל**

קרנות הון סיכון בחו"ל 11,387.940  
 קרנות נדלן בחו"ל  
 קרנות גידור בחו"ל  
 קרנות השקעה אחרות בחו"ל 129,014.725

**8. כתבי אופציה**

כתבי אופציה סחירים בישראל מסוג warrant 98.064  
 כתבי אופציה לא סחירים בישראל מסוג warrant  
 כתבי אופציה סחירים בחו"ל מסוג warrant 431.914  
 כתבי אופציה לא סחירים בחו"ל מסוג warrant

**9. חוזים עתידיים (SWAP,FWD)**

**בישראל - סחיר**

חוזים עתידיים סחירים בארץ

**בישראל - לא סחיר**

חוזים עתידיים על מדדים כולל מניות

חוזים עתידיים על שקל/מטח

חוזים עתידיים על מטח/מטח

חוזים עתידיים על ריבית

חוזים עתידיים אחרים

**בח"ל - סחיר**

חוזים עתידיים סחירים בחו"ל

**בח"ל - לא סחיר**

חוזים עתידיים על מדדים כולל מניות בחו"ל

חוזים עתידיים על מטח בחו"ל

חוזים עתידיים על ריבית בחו"ל

חוזים עתידיים אחרים בחו"ל

**10. אופציות**

**בישראל - סחיר**

אופציות על מדדים כולל מניות

אופציות על מטבעות

אופציות על ריבית

אופציות על מדד/נכס אחר

אופציות על מדדים כולל מניות (short)

אופציות על מטבעות (short)

אופציות על ריבית (short)

אופציות על מדד/נכס אחר (short)

**בישראל - לא סחיר**

אופציות על מדדים כולל מניות

אופציות על ש"ח/מט"ח

אופציות על מט"ח/מט"ח

אופציות על ריבית

אופציות על מדד/נכס אחר

אופציות על מדדים כולל מניות (short)

אופציות על ש"ח/מט"ח (short)

אופציות על מט"ח/מט"ח (short)

אופציות על ריבית (short)

אופציות על מדד/נכס אחר (short)

**בח"ל - סחיר**

אופציות על מדדים כולל מניות בחול

אופציות על מטבעות בחול

אופציות על ריבית בחול

אופציות על סחורות בחול

אופציות על מדד/נכס אחר בחול

אופציות על מדדים כולל מניות בחול (short)

אופציות על מטבעות בחול (short)

אופציות על ריבית בחול (short)

אופציות על סחורות בחול (short)

אופציות על מדד/נכס אחר בחול (short)

**בח"ל - לא סחיר**

אופציות על מדדים כולל מניות בחול

אופציות על מטבעות בחול

אופציות על ריבית בחול

אופציות על סחורות בחול

אופציות על מדד/נכס אחר בחול

אופציות על מדדים כולל מניות בחול (short)

אופציות על מטבעות בחול (short)

אופציות על ריבית בחול (short)

אופציות על סחורות בחול (short)

אופציות על מדד/נכס אחר בחול (short)

**11. מוצרים מובנים**

**בישראל**

**סחיר**

**א. קרן מובטחת**



מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס ריבית  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מטבע  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מדד  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר

#### ג. פיקדונות מובנים

פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס אשראי  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מניות  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס ריבית  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מטבע  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מדד  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס אחר

#### ד. מוצרים מאוגחים

שכבת חוב (Tranch) בדירוג AA- ומעלה בחו"ל  
שכבת חוב (Tranch) בדירוג BBB- ועד A+ ומעלה בחו"ל  
שכבת חוב (Tranch) בדירוג BB+ ומעלה בחו"ל  
שכבת חוב (Equity Tranch) בחו"ל

#### לא סחיר

#### א. קרן מובטחת

מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר

#### ב. קרן לא מובטחת

מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס ריבית  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מטבע  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מדד  
מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר

#### ג. פיקדונות מובנים

פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס אשראי  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מניות  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס ריבית  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מטבע  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מדד  
פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס אחר

#### ד. מוצרים מאוגחים

שכבת חוב (Tranch) בדירוג AA- ומעלה בחו"ל  
שכבת חוב (Tranch) בדירוג BBB- ועד A+ ומעלה בחו"ל  
שכבת חוב (Tranch) בדירוג BB+ ומעלה בחו"ל  
שכבת חוב (Equity Tranch) בחו"ל

#### ג. הלוואות

#### בישראל

הלוואה לעמיתים

תיקי משכנתאות בדירוג BBB- ומעלה

תיקי משכנתאות בדירוג נמוך

הלוואה עם ערבות בנקאית בדירוג AA- ומעלה

הלוואה עם ערבות בנקאית בדירוג A+:BBB-

הלוואה עם ערבות בנקאית בדירוג נמוך מ-BBB- או ללא דרוג

הלוואה בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג AA- ומעלה

הלוואה בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג A+:BBB-

הלוואות בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה לא מדורגת עם בטוחה מספקת

הלוואות בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה לא מדורגת

הלוואות לא מובטחות

#### בחו"ל

תיקי משכנתאות בחו"ל

הלוואות בחו"ל בערבות בנקאית

הלוואות בחו"ל מובטחות בביטונות אחרים

הלוואות בחול לא מובטחות

**ד. פיקדונות לתקופה העולה על שלושה חודשים מיום ההנפקה בישראל**

פקדונות צמודי מדד בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות לא צמודים בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות צמודי מט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות לא צמודים בדירוג AA- ומעלה לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות צמודי מט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות אחרים בדירוג AA- ומעלה  
פקדונות צמודי מדד בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות לא צמודים בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות צמודי מט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות צמודי מדד בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות לא צמודים בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות צמודי מט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות אחרים בדירוג A+:BBB-  
פקדונות צמודי מדד בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות לא צמודים בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות צמודי מט"ח בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה  
פקדונות צמודי מדד בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות לא צמודים בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות צמודי מט"ח בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה  
פקדונות אחרים בדירוג נמוך

**ה. בחו"ל**

פקדונות נקובים במט"ח בדירוג A- ומעלה  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג BBB+:BBB-  
פקדונות נקובים במט"ח בדירוג נמוך

**ו. מקרקעין**

מקרקעין מניבים  
מקרקעין לא מניבים  
מקרקעין מניבים בחו"ל  
מקרקעין לא מניבים בחו"ל

**ז. השקעות אחרות**

התחייבות בגין מכירה בחסר  
נ"ע סחירים אחרים ישראלים בחו"ל  
נ"ע סחירים אחרים זרים בחו"ל  
התחייבות בגין מכירה בחסר בחול

**ח. רכוש קבוע**

בנייני משרדים שבשימוש הקופה  
רכוש קבוע שאינו בנייני משרדים בשימוש הקופה

**ט. חייבים וזכאים**

חייבים שונים  
זכאים  
זכאים מס הכנסה  
עמיתים זכאים בגין החזרי מס  
עמיתים זכאים בגין שיקים שמועד פרעונם עבר

**י. אחרים**

הפרשי שער  
דמי השאלה  
ריבית פיגורים בגין איחור בהעברת זכויות עמיתים  
ריבית פיגורים בגין חובות מעבידים  
מס הכנסה בגין רווחי השקעות  
מס שבח

**יא. סה"כ נכסי הקופה**

**סה"כ תקבולים מתזרים מנכסים**

143.362  
423.461

2,150.812  
-1,231.420  
-139.574

**1,607,370.308**