

29 במאי, 2023

לכבוד
מור פנסיה מקיפה - קרן פנסיה חדשה
דוד בן גוריון 2
רמת גן

א.ג.ג.,

הנדון: דוח מיוחד בדבר הדוח החודשי לחודש מרס, 2023

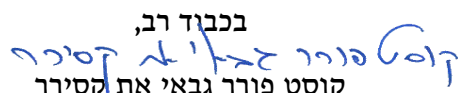
סקרנו את הנתונים הכספיים הכלולים בדוח החודשי של מור פנסיה מקיפה - קרן פנסיה חדשה (להלן - הקרן) המנוהלת על ידי מור גמל ופנסיה בע"מ (להלן - החברה המנהלת), לחודש מרס, 2023, המצורף בזאת ומסומן בחותמתנו לשם זיהוי (להלן - הדוח). דירקטוריון החברה המנהלת אחראי לדיווח ולהצגה של הדוח בהתאם להנחיות הממונה על רשות שוק ההון, ביטוח וחסכון. אחריותנו היא להביע מסקנה על הדוח החודשי בהתבסס על סקירתנו.

סקירתנו נערכה בהתאם לנהלים שכללו: קריאת הדוח הנ"ל, התאמת הנתונים הכלולים בדוחות לרישומים בספרי החשבונות של הקרן, עריכת בירורים עם האחראים להכנת הדוח החודשי ויישום נהלי סקירה אנליטיים ואחרים.

מאחר שהסקירה שנערכה היא מצומצמת בהיקפה ואינה מהווה בדיקה בהתאם לתקני ביקורת מקובלים, אין אנו מחוויים דעה על הנתונים הכלולים בדוח.

קיימים הפרשים בהרכב הנכסים, בין הדוח החודשי לבין הרכב הנכסים על-פי הדוח הכספי ליום 31 במרס, 2023 כפי שהתפרסם על-ידי הקופה. ראה נספח א' לעניין ההפרשים עיקריים שנמצאו.

פרט לאמור לעיל, בביצוע סקירתנו, לא בא לתשומת ליבנו דבר הגורם לנו לסבור שיש צורך בשינויים מהותיים בנתונים בדבר סך נכסי הקרן הכלולים בדוח האמור, כדי שיוכלו להיחשב כנתונים המבוססים על ספרי הקרן ודוחותיה.

בכבוד רב,

קוסט פורר גבאי את קסירר
רואי חשבון

נספח א'

מור פנסיה מקיפה - קרן פנסיה חדשה הפרשים עיקריים בדיווח החודשי לאוצר

הפרש	הנתונים לפי הדוח		
	הכספי	הנתונים לפי הדוח	
	ליום 31/03/23	החודשי 03/2023	
באלפי ש"ח			
(508)	1,499,104	1,498,596	(1)
518	767	1,285	(1)

השקעות פיננסיות

חייבים אחרים

1. הפער בין סך ההשקעות הפיננסיות המוצגות בדוח החודשי לבין היתרות המדווחות בדוח הכספי נובע מסכומי ריבית לקבל שבדוח החודשי מוצגים בסעיף חייבים ואילו בדוח הכספי הוצגו כחלק מהנכסים הפיננסים. כמו כן, בדוח החודשי, נגזרים שליליים מקוזזים מהנכסים הפיננסים ואילו בדוח הכספי מוצגים בסעיף זכאים.

קוסט פורר גבאי את קסיר
 רואי חשבון
 (נחתם למטרת זיהוי בלבד)

קוד אוצר		נכסים
		א. מזומנים ושווי מזומנים
		בישראל
DA12	יתרות מזומנים ועו"ש בשקלים חדשים	310,113
DT11	יתרות מזומנים ועו"ש נקובים במט"ח	55,334
DA10	פח"ק / פרי"י	-
DT420	פק"מ לתקופה של עד שלושה חודשים	-
DT421	פיקדון צמוד מדד לתקופה של עד שלושה חודשים	-
DT422	פיקדון צמוד מט"ח לתקופה של שלושה חודשים (פצ"מ)	-
DT423	פיקדונות במט"ח לתקופה של עד שלושה חודשים	21,663
		בחו"ל
DT191	יתרות מזומנים ועו"ש נקובים במט"ח חו"ל	-
DT424	פיקדונות במט"ח לתקופה של עד שלושה חודשים	25
		ב. ניירות ערך
		1. אגרות חוב ממשלתיות
		בישראל
		א. סחיר
DT13	אגרות חוב ממשלתיות סחירות צמודות מדד	23,965
DT15	אגרות חוב ממשלתיות סחירות לא צמודות בריבית קבועה (שחר)	14,608
DT16	אגרות חוב ממשלתיות סחירות לא צמודות בריבית משתנה (גילון)	7,726
DT14	אגרות חוב ממשלתיות סחירות צמודות מט"ח	-
DA9	מק"מ	205,589
		ב. לא סחיר
DT1	אגרות חוב מיועדות מסוג "מירון"	-
DT400	אגרות חוב מיועדות מסוג "ערד" (ריבית 4.86%)	186,017
DT401	אגרות חוב מיועדות מסוג "ערד" (ריבית 5.05%)	-
DT3	אגרות חוב מיועדות אחרות	-
DA8	פיקדונות חשכ"ל	-
DT901	החזקה באפיק השקעה מובטח תשואה	317,691
		בחו"ל
		א. סחיר
DT17	אגרות חוב של ממשלת ישראל שהונפקו בחו"ל	-
DT26	אגרות חוב סחירות שהנפיקו ממשלות זרות בחו"ל	14,283
		ב. לא סחיר
DT425	אגרות חוב לא סחירות של ממשלת ישראל שהונפקו בחו"ל	-
DT426	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו ממשלות זרות בחו"ל	-
		2. תעודות חוב מסחריות
		בישראל
		א. סחיר
DT427	תעודות חוב מסחריות סחירות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT561	תעודות חוב מסחריות סחירות לא צמודות בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT560	תעודות חוב מסחריות סחירות צמודות מט"ח בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT428	תעודות חוב מסחריות סחירות צמודות מדד בדירוג (BBB: +A)	-
DT563	תעודות חוב מסחריות סחירות לא צמודות בדירוג (BBB: +A)	-
DT562	תעודות חוב מסחריות סחירות צמודות מט"ח בדירוג (BBB: +A)	-
DT429	תעודות חוב מסחריות סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT565	תעודות חוב מסחריות סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT564	תעודות חוב מסחריות סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
		ב. לא סחיר
DT430	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה	-

קוסט פור גבאי את קסיר
רואי חשבון
(נחתם למטרת זיהוי בלבד)

תאריך: 20200901

DT567	תעודות חוב מסחריות לא סחירות לא צמודות בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT566	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT431	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מדד בדירוג (BBB: +A)	-
DT569	תעודות חוב מסחריות לא סחירות לא צמודות בדירוג (BBB: +A)	-
DT568	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג (BBB: +A)	-
DT432	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT573	תעודות חוב מסחריות לא סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT572	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT547	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת	מספקת
DT571	תעודות חוב מסחריות לא סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת	מספקת
DT570	תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת	מספקת
	בח"ל	-
	א. סחיר	-
DT601	תעודות חוב מסחריות סחירות בחו"ל חברות ישראליות בדירוג (A-) ומעלה	-
DT602	תעודות חוב מסחריות סחירות בחו"ל חברות ישראליות בדירוג (BBB: +BBB)	-
DT603	תעודות חוב מסחריות סחירות בחו"ל חברות ישראליות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT604	תעודות חוב מסחריות סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג (A-) ומעלה	-
DT605	תעודות חוב מסחריות סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג (BBB: +BBB)	-
DT606	תעודות חוב מסחריות סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
	ב. לא סחיר	-
DT607	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות ישראליות בדירוג (A-) ומעלה	-
DT608	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות ישראליות בדירוג (BBB: +BBB)	-
DT609	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות ישראליות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת	כנגדן בטוחה מספקת
DT610	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות ישראליות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT611	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג (A-) ומעלה	-
DT612	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג (BBB: +BBB)	-
DT613	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת	בטוחה מספקת
DT614	תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
	3. אגרות חוב קונצרניות	-
	בישראל	-
	א. סחיר	-
DT301	אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה	43,511
DT303	אגרות חוב קונצרניות סחירות לא צמודות בדירוג (AA-) ומעלה	12,799
DT302	אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מט"ח בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT307	אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מדד בדירוג (BBB: +A)	14,171
DT309	אגרות חוב קונצרניות סחירות לא צמודות בדירוג (BBB: +A)	19,422
DT308	אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מט"ח בדירוג (BBB: +A)	4,130
DT313	אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	6,717
DT315	אגרות חוב קונצרניות סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	9,866
DT314	אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT615	אגרות חוב קונצרניות אחרות בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT616	אגרות חוב קונצרניות אחרות בדירוג (BBB: +A)	-
DT617	אגרות חוב קונצרניות אחרות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
	ב. לא סחיר	-
DT319	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה	2,089
DT321	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג (AA-) ומעלה	739
DT320	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT325	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג (BBB: +A)	-
DT327	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג (BBB: +A)	2,981
DT326	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג (BBB: +A)	-

קוסט פורר גבאי את קטיר
רואי חשבון
(נחתם למטרת זיהוי בלבד)

תאריך: 01/01/2020

DT553	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת
DT555	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת
DT554	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת
DT337	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
DT339	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
DT338	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
DT618	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות אחרות בדירוג (AA-) ומעלה
DT619	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות אחרות בדירוג (BBB: + A)
DT620	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות אחרות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת
DT621	אגרות חוב קונצרניות לא סחירות אחרות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
	בחו"ל
	א. סחיר
DT454	אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג (A-) ומעלה
DT455	אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג (BBB: + BBB)
DT456	אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
DT457	אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג (A-) ומעלה
DT458	אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג (BBB: + BBB)
DT459	אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
	ב. לא סחיר
DT460	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג (A-) ומעלה
DT461	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג (BBB: + BBB)
DT462	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
DT558	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת
DT463	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג (A-) ומעלה
DT464	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג (BBB: + BBB)
DT465	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות
DT559	אגרות חוב לא סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות שעומדות כנגדן בטוחה מספקת
	4. מניות
	בישראל
	א. סחיר
DT402	מניות השייכות למדד ת"א 35
DT403	מניות השייכות למדד ת"א 90
DT404	מניות היתר
DT405	מניות זרות הנסחרות בארץ
DT172	אופציות call (long) 001
DT205	אופציות call (short) 001
	ב. לא סחיר
DC9	מניות לא סחירות
	בחו"ל
	א. סחיר
DT28	מניות של חברות ישראליות שנסחרות בחו"ל
DT30	מניות סחירות של תאגיד תושב חוץ בשיעור החזקה של עד 10% בחו"ל
DT81	מניות סחירות של תאגיד תושב חוץ בשיעור החזקה של 10% ומעלה בחו"ל
	ב. לא סחיר
DT622	מניות לא סחירות של חברות ישראליות שנסחרות בחו"ל
DT83	מניות לא סחירות של חברות זרות בחו"ל
	5. השקעה בתעודות סל
	נסחרות בארץ
DT360	השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי מניות בארץ
DT361	השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי מניות בחו"ל

קוסט פורר גבאי את קסירר
רואי חשבון
(נחתם למטרת זיהוי בלבד)

50,201	השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי אג"ח בארץ	DT362
-	השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי אג"ח בחו"ל	DT363
-	השקעה בתעודות סל בחסר בארץ	DT406
-	השקעה בתעודות סל אחרות בארץ	DT623
-	נסחרות בחו"ל	
-	השקעה בתעודות סל שנסחרות בחו"ל שמחקות מדדי מניות	DT366
-	השקעה בתעודות סל שנסחרות בחו"ל שמחקות מדדי אג"ח	DT367
-	השקעה בתעודות סל בחסר בחו"ל	DT407
-	השקעה בתעודות סל אחרות בחו"ל	DT624
-	6. תעודות השתתפות בקרנות נאמנות	
-	בישראל	
123,759	תעודות השתתפות בקרן נאמנות	DB10
-	בחו"ל	
-	תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- אג"ח קונצרני	DT701
-	תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- אג"ח ממשלתי	DT702
-	תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- מניות	DT703
-	תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- אחר	DT704
-	7. קרנות השקעה	
-	בישראל	
-	קרנות הון סיכון	DT53
-	קרנות גידור	DT466
-	קרנות נדל"ן	DT225
-	קרנות השקעה אחרות	DT52
-	בחו"ל	
21,311	קרנות הון סיכון בחו"ל	DT89
12,889	קרנות גידור בחו"ל	DT467
-	קרנות נדל"ן בחו"ל	DT226
18,105	קרנות השקעה אחרות בחו"ל	DT88
-	8. כתבי אופציה (WARRANTS)	
-	בישראל	
-	א. סחיר	
606	כתבי אופציות סחירים	DB5
-	ב. לא סחיר	
1,239	כתבי אופציה לא סחיר	DT439
-	בחו"ל	
-	א. סחיר	
-	כתבי אופציות סחירים בחו"ל	DT211
-	ב. לא סחיר	
27,601	כתבי אופציות לא סחירים בחו"ל	DT440
-	9. חוזים עתידיים	
-	בישראל	
-	א. סחיר	
-	חוזים עתידיים סחירים - FUTURES	DT749
-	ב. לא סחיר	
-	חוזים עתידיים על מדדים כולל מניות (FORWARD, SWAP) לא סחירים	DT441
-	חוזים עתידיים על ש"ח/מט"ח (FORWARD, SWAP) לא סחירים	DT442
-	חוזים עתידיים על מט"ח/מט"ח (FORWARD, SWAP) לא סחירים	DT443
-	חוזים עתידיים על ריבית (FORWARD, SWAP) לא סחירים	DT444
-	חוזים עתידיים אחרים (FORWARD, SWAP) לא סחירים	DT445
-	בחו"ל	

קוסט פורר גבאי את קסירר
 רואי חשבון
 (נחתם למטרת זיהוי בלבד)

תאריך: 2020.09.01

	א. סחיר	
DT212	חוזים עתידיים סחירים - FUTURES בחו"ל	30,128
	ב. לא סחיר	
DT446	חוזים עתידיים על מדדים כולל מניות (FORWARD, SWAP) בחו"ל לא סחירים	-
DT447	חוזים עתידיים על מטבע (FORWARD, SWAP) בחו"ל לא סחירים	-
DT448	חוזים עתידיים על ריבית (FORWARD, SWAP) בחו"ל לא סחירים	-
DT449	חוזים עתידיים אחרים (FORWARD, SWAP) בחו"ל לא סחירים	-
	10. אופציות	
	בישראל	
	א. סחיר	
DT468	אופציות על מדדים כולל מניות סחירות (long)	-
DT469	אופציות על מדדים כולל מניות סחירות (short)	-
DT175	אופציות על ש"ח/מט"ח סחירות (long)	-
DT208	אופציות על ש"ח/מט"ח סחירות (short)	-
DT176	אופציות על ריבית סחירות (long)	-
DT209	אופציות על ריבית סחירות (short)	-
DT177	אופציות על מדדים/נכסים אחרים סחירות (long)	-
DT210	אופציות על מדדים/נכסים אחרים סחירות (short)	-
	ב. לא סחיר	
DT470	אופציות על מדדים כולל מניות לא סחירות (long)	-
DT472	אופציות על מדדים כולל מניות לא סחירות (short)	-
DT345	אופציות על ש"ח/מט"ח לא סחירות (long)	-
DT347	אופציות על ש"ח/מט"ח לא סחירות (short)	-
DT625	אופציות על מט"ח/מט"ח לא סחירות (long)	-
DT626	אופציות על מט"ח/מט"ח לא סחירות (short)	-
DT471	אופציות על ריבית לא סחירות (long)	-
DT473	אופציות על ריבית לא סחירות (short)	-
DT346	אופציות אחרות לא סחירות (long)	-
DT348	אופציות אחרות לא סחירות (short)	-
	בחו"ל	
	א. סחיר	
DT213	אופציות על מדדים כולל מניות בחו"ל סחירות (long)	-
DT217	אופציות על מדדים כולל מניות בחו"ל סחירות (short)	-
DT214	אופציות על מטבע בחו"ל סחירות (long)	-
DT218	אופציות על מטבע בחו"ל סחירות (short)	-
DT215	אופציות על ריבית בחו"ל סחירות (long)	-
DT219	אופציות על ריבית בחו"ל סחירות (short)	-
DT216	אופציות על סחורות בחו"ל סחירות (long)	-
DT220	אופציות על סחורות בחו"ל סחירות (short)	-
DT474	אופציות על מדדים/נכסים אחרים בחו"ל סחירות (long)	-
DT475	אופציות על מדדים/נכסים אחרים בחו"ל סחירות (short)	-
	ב. לא סחיר	
DT476	אופציות על מדדים כולל מניות בחו"ל לא סחירות (long)	-
DT481	אופציות על מדדים כולל מניות בחו"ל לא סחירות (short)	-
DT477	אופציות על מטבע בחו"ל לא סחירות (long)	-
DT482	אופציות על מטבע בחו"ל לא סחירות (short)	-
DT478	אופציות על ריבית בחו"ל לא סחירות (long)	-
DT483	אופציות על ריבית בחו"ל לא סחירות (short)	-
DT479	אופציות על סחורות בחו"ל לא סחירות (long)	-
DT484	אופציות על סחורות בחו"ל לא סחירות (short)	-

קוסט פורר גבאי את קסירר
רואי חשבון
(נחתם למטרת זיהוי בלבד)

DT480	אופציות על מדדים/נכסים בחו"ל לא סחירות (long)	ונאריך: 01/01/2020
DT485	אופציות על מדדים/נכסים בחו"ל לא סחירות (short)	-
	11. מוצרים מובנים	-
	בישראל	-
	א. סחיר	-
	קרן מובטחת	-
DT705	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT706	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT707	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT708	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT709	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	239
DT710	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	קרן לא מובטחת	-
DT711	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT712	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT713	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT714	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT715	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT716	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	פקדונות מובנים	-
DT717	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT718	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT719	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT720	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT721	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT722	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	מוצרים מאוגחים	-
DT723	שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (-AA) ומעלה	-
DT724	שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (-BBB: +A)	-
DT725	שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (+BB) ומטה	-
DT726	שכבת הון (Equity Tranch) בישראל	-
	ב. לא סחיר	-
	קרן מובטחת	-
DT646	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT647	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT648	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT649	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT650	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT651	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	קרן לא מובטחת	-
DT652	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT653	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT654	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT655	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT656	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT657	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	פקדונות מובנים	-
DT678	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT679	פקדונות מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT680	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-

קוסט פורר גבאי את קסירר
רואי חשבון
(נחתם למטרת זיהוי בלבד)

DT681	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	ונאריך: 11/11/2020
DT682	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT683	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	מוצרים מאוגחים	-
DT658	שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (-AA) ומעלה	-
DT659	שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (-BBB: +A)	-
DT660	שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (+BB) ומטה	-
DT661	שכבת הון (Equity Tranch) בישראל	-
	בחו"ל	-
	א. סחיר	-
	קרן מובטחת	-
DT727	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT728	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT729	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT730	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT731	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT732	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	קרן לא מובטחת	-
DT733	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT734	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT735	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT736	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT737	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT738	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	פקדונות מובנים	-
DT739	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT740	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT741	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT742	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT743	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT744	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	מוצרים מאוגחים	-
DT745	שכבת חוב (Tranch) בחו"ל בדירוג (-AA) ומעלה	-
DT746	שכבת חוב (Tranch) בחו"ל בדירוג (-BBB: +A)	-
DT747	שכבת חוב (Tranch) בחו"ל בדירוג (+BB) ומטה	-
DT748	שכבת הון (Equity Tranch) בחו"ל	-
	ב. לא סחיר	-
	קרן מובטחת	-
DT662	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT663	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT664	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT665	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT666	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT667	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	קרן לא מובטחת	-
DT668	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT669	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT670	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT671	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT672	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מדד	-

קוסט פורר גבאי את קסיר
רואי חשבון
(נחתם למטרת זיהוי בלבד)

DT673	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר	ותאריך: -
	פקדונות מובנים	-
DT684	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי	-
DT685	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות	-
DT686	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית	-
DT687	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע	-
DT688	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד	-
DT689	פקדונות מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר	-
	מוצרים מאוגחים	-
DT674	שכבת חוב (Tranch) בחו"ל בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT675	שכבת חוב (Tranch) בחו"ל בדירוג (BBB: +A)	-
DT676	שכבת חוב (Tranch) בחו"ל בדירוג (BBB: +A) ומטה	-
DT677	שכבת הון (Equity Tranch) בחו"ל	-
	ג. הלוואות	-
	בישראל	-
DC1	הלוואות לעמיתים	-
DT502	תיקי משכנתאות בדירוג (BBB-) ומעלה, או שעומדת כנגדם בטוחה מספקת, או משכנתא ראשונה על זכות במקרקעין או התחייבות לרישום משכנתא	-
DT503	תיקי משכנתאות בדירוג הנמוך מ (BBB-)	-
DT450	הלוואות עם ערבות בנקאית בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT504	הלוואות עם ערבות בנקאית בדירוג (BBB: +A)	-
DT505	הלוואות עם ערבות בנקאית בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT451	הלוואות מובטחות בביטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT506	הלוואות מובטחות בביטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג (BBB: +A)	-
DT627	הלוואות מובטחות בביטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגותשעומדות כנגדן בטוחה מספקת	-
DT507	הלוואות מובטחות בביטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
DT577	הלוואות לא מובטחות	11,123
	בחו"ל	-
DT508	תיקי משכנתאות בחו"ל שעומדת כנגדם בכל עת בטוחה מספקת, או משכנתא ראשונה על זכות במקרקעין או התחייבות לרישום משכנתא שנרשם על	-
DT509	הלוואות בחו"ל מובטחות בערבות בנקאית	-
DT511	הלוואות בחו"ל מובטחות בביטחונות אחרים	-
DT452	הלוואות בחו"ל לא מובטחות	-
	ד. פיקדונות לתקופה העולה על שלושה חודשים	-
	בישראל	-
DT512	פיקדונות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT513	פיקדונות לא צמודות בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT514	פיקדונות נקובים במט"ח בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT515	פיקדונות צמודות מט"ח בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT516	פיקדונות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שנה	-
DT517	פיקדונות לא צמודות בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שנה	-
DT518	פיקדונות נקובים במט"ח בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שנה	-
DT519	פיקדונות צמודות מט"ח בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שנה	-
DT520	פיקדונות צמודות מדד בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT521	פיקדונות לא צמודות בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT522	פיקדונות נקובים במט"ח בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT523	פיקדונות צמודות מט"ח בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT524	פיקדונות צמודות מדד בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שנה	-
DT525	פיקדונות לא צמודות בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שנה	-
DT526	פיקדונות נקובים במט"ח בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שנה	-
DT527	פיקדונות צמודות מט"ח בדירוג (BBB: +A) לתקופה של מעל שנה	-
DT530	פיקדונות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגותלתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-

DT531	פיקדונות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT532	פיקדונות נקובים במט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT533	פיקדונות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה	-
DT534	פיקדונות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שנה	-
DT535	פיקדונות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שנה	-
DT536	פיקדונות נקובים במט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שנה	-
DT537	פיקדונות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שנה	-
DT628	פיקדונות אחרים בדירוג (AA-) ומעלה	-
DT629	פיקדונות אחרים בדירוג (BBB: +A)	-
DT630	פיקדונות אחרים בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
	בחו"ל	-
DT631	פקדונות בחו"ל נקובים במט"ח בדירוג (A-) ומעלה	-
DT632	פקדונות בחו"ל נקובים במט"ח בדירוג (BBB: +BBB)	-
DT633	פקדונות בחו"ל נקובים במט"ח בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות	-
	ה. זכויות במקרקעין	-
	בישראל	-
DT111	זכויות במקרקעין מניבים	-
DT112	זכויות במקרקעין לא מניבים	-
	בחו"ל	-
DT113	זכויות במקרקעין מניבים בחו"ל	-
DT114	זכויות במקרקעין לא מניבים בחו"ל	-
	ו. השקעות אחרות	-
	בישראל	-
DT116	התחייבויות בגין צכירה בחסר של ני"ע סחירים	-
	בחו"ל	-
DT29	ני"ע סחירים אחרים שהנפיקו תאגידים ישראלים בחו"ל	-
DT31	ני"ע סחירים אחרים של מנפיקים זרים בחו"ל	-
DT117	התחייבויות בגין מכירה בחסר של ני"ע סחירים בחו"ל	-
	ז. רכוש קבוע	-
DT115	בנייני משרדים ששימוש הקופה	-
DT62	רכוש קבוע שאינו בנייני משרדים, בניכוי פחת נצבר	-
	ח. חייבים זכאים שונים	-
DT54	חייבים שונים	1,285
DT55	זכאים	-21,299
DT92	זכאים מס הכנסה	-2
DT353	עמיתים זכאים בגין החזרי מס	-
DT369	עמיתים זכאים בגין שיקים שמועד פרעונם עבר	-
DT546	סך ההתחייבויות הממשלתיות בגין אי העלאת גיל הפרישה לנשים	-
DE1	סה"כ נכסי המסלול	1,865,714