

תיאור חובות בעייתיים בתיק אשראי לא מוחרג

קופת גמל לתגמולים ולפיצויים בע"מ 50 ומטה

סיווג פרום חוב	תשואה ברוטו	מח"מ מחושב	דרג מידרוג לנייר	דרג מעלות לנייר	אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	כמות	תאור נייר
השגחה מיוחדת	8.69	0.92		N/R	0.48%	18,595.58	18,577.00	אמפא יובל אגח א
Total					0.48%	18,595.58	18,577.00	

נכון לתאריך הדוח. אין בתיק חשיפה נוספת לנכסי חוב או נכסים אחרים שהונפקו על ידי מנפיקים אלה

תאור נייר סכום מנפיקים תאור מנפיק

3,879,637

סה"כ אשראי לא מוחרג

תיאור חובות בעייתיים בתיק אשראי לא מוחרג

קופת גמל לתגמולים ולפיצויים בע"מ 50 ומטה

סהתפלגות חוב בעייתית על פי ענפים

אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	תאור ענף
100.00%	18,595.58	נדל"ן מניב
100.00%	18,595.58	

התפלגות חוב בעייתית על פי קבוצת לווים

אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	תאור קבוצת לווים
100.00%	18,595.58	אמפא, יצחק ברוך
100.00%	18,595.58	

התפלגות חוב בעייתית על פי דירוג

אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	דרוג קובע לנייר
100.00%	18,595.58	N/R
100.00%	18,595.58	

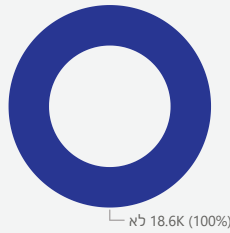
בנון לתאריך הדוח, אין בתיק חשיפה נוספת לנכסי חוב או נכסים אחרים שהונפקו על ידי קבוצת הלוים הנל

תאור נייר תאור קבוצת לווים

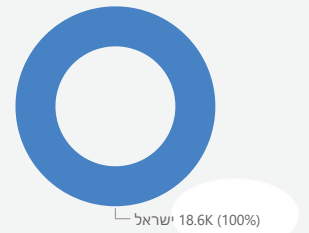
התפלגות חוב בעייתית על פי סחירות



התפלגות חוב בעייתית על פי ביטחונות



התפלגות חוב בעייתית על פי חשיפה גאוגרפית



ניתוח חשיפות מהותיות בתיק אשראי-השוואה תקופתית

מסלול 50-60 קו הבריאות
30/09/2024

30/06/2024

לווה יחיד

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור מנפיק
1.52%	7.37%	בנק לאומי לישראל בע"מ
1.13%	5.50%	בנק הפועלים בע"מ
1.00%	4.87%	iShares USD Short Duration Cor

לווה יחיד

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור מנפיק
1.11%	4.77%	בנק הפועלים בע"מ
1.05%	4.54%	בנק לאומי לישראל בע"מ
0.82%	3.53%	קבוצת עזריאלי בע"מ

ענפים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור ענף
5.29%	25.69%	נדל"ן מניב
4.61%	22.42%	בנקים
1.85%	9.00%	ביטוח

ענפים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור ענף
5.40%	23.26%	נדל"ן מניב
4.11%	17.69%	בנקים
2.12%	9.14%	ביטוח

קבוצת לווים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור קבוצת לווים
1.52%	7.37%	בנק לאומי
1.34%	6.50%	בנק הפועלים
1.16%	5.66%	נתן חץ

קבוצת לווים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור קבוצת לווים
1.31%	5.66%	בנק הפועלים
1.29%	5.58%	בנק לאומי
0.83%	3.59%	אייל עופר, משפחת ורטהיים

תיאור חובות בעייתיים בתיק אשראי לא מוחרג

מסלול 50-60 קו הבריאות

סיווג פרום חוב	תשואה ברוטו	מח"מ מחושב	דרג מידרוג לנייר	דרג מעלות לנייר	אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	כמות	תאור נייר
השגחה מיוחדת	8.69	0.92		N/R	0.46%	1,315,710.40	1,314,396.00	אמפא יובל אגח א
בפיגור	-99.99	0.00	N/R		0.00%	0.09	90,021.81	אמפל אמרי אגח ב
בפיגור		0.00	N/R		0.00%	0.09	90,021.81	אמפל אמ ב' חש
בפיגור		0.00	N/R		0.00%	0.09	90,021.81	אמפלאמ ב חש 1/13
בפיגור		0.00	N/R		0.00%	0.09	90,021.80	אמפלאמ ב חש 1/14
בפיגור		0.00	N/R		0.00%	0.08	75,160.87	אגרסקו אגח א - חש 4/2012
בפיגור			C		0.00%	0.00	375,804.53	אגרסקו אגח א לס 2017
בפיגור		0.00		N/R	0.00%	0.00	90,021.81	אמפלאמ ב חש 1.12
מסופק		0.00		D	0.00%	0.00	1,077,381.81	אלון חברת הדלק אגח סד' א-קו הבריאות
Total					0.46%	1,315,710.84	3,292,852.25	

נכון לתאריך הדוח, אין בתיק חשיפה נוספת לנכסי חוב או נכסים אחרים שהונפקו על ידי מנפיקים אלה

סה"כ אשראי לא מוחרג 282,991,370

תיאור חובות בעייתיים בתיק אשראי לא מוחרג

מסלול 50-60 קו הבריאות

התפלגות חוב בעייתי על פי ענפים

אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	תאור ענף
100.00%	1,315,710.47	נדל"ן מניב
100.00%	1,315,710.47	

התפלגות חוב בעייתי על פי קבוצת לווים

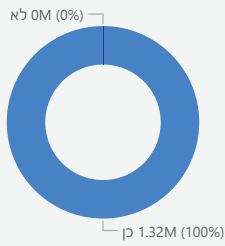
אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	תאור קבוצת לווים
100.00%	1,315,710.40	אמפא, יצחק ברוך
100.00%	1,315,710.40	

התפלגות חוב בעייתי על פי דירוג

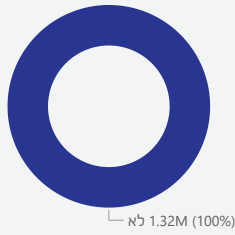
אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	דרוג קובע לנייר
100.00%	1,315,710.83	N/R
0.00%	0.00	C
0.00%	0.00	D
100.00%	1,315,710.84	

נכון לתאריך הדוח, אין בתיק חשיפה נוספת לנכסי חוב או נכסים אחרים שהונפקו על ידי קבוצות הלווים הנל

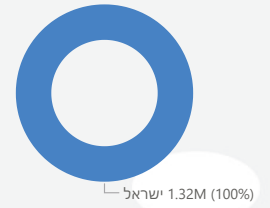
התפלגות חוב בעייתי על פי סחירות



התפלגות חוב בעייתי על פי ביטחונות



התפלגות חוב בעייתי על פי חשיפה גאוגרפית



ניתוח חשיפות מהותיות בתיק אשראי-השוואה תקופתית

קופת גמל לתגמולים ולפיצויים בע"מ 60 ומעלה

30/09/2024

לווה יחיד

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור מנפיק
2.79%	10.35%	בנק לאומי לישראל בע"מ
2.73%	10.14%	מזרחי חברה להנפקות
2.44%	9.05%	בנק הפועלים בע"מ

ענפים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור ענף
9.22%	34.23%	בנקים
5.77%	21.42%	נדל"ן מניב
2.20%	8.17%	מוצרי מדדים- אג"ח-תעודות סל

קבוצת לווים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור קבוצת לווים
2.82%	10.49%	אייל עופר, משפחת ורטהיים
2.79%	10.35%	בנק לאומי
2.67%	9.90%	בנק הפועלים

30/06/2024

לווה יחיד

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור מנפיק
2.30%	8.25%	מזרחי חברה להנפקות
2.13%	7.65%	בנק לאומי לישראל בע"מ
1.50%	5.38%	בנק הפועלים בע"מ

ענפים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור ענף
7.30%	26.22%	בנקים
6.12%	21.98%	נדל"ן מניב
1.94%	6.96%	אנרגיה

קבוצת לווים

אחוז מכלל התיק	אחוז מתיק אשראי לא מוחרג	תאור קבוצת לווים
2.38%	8.56%	אייל עופר, משפחת ורטהיים
2.36%	8.49%	בנק לאומי
1.71%	6.15%	בנק הפועלים

תיאור חובות בעייתיים בתיק אשראי לא מוחרג

קופת גמל לתגמולים ולפיצויים בע"מ 60 ומעלה

סיווג פרום חוב	תשואה ברוטו	מח"מ מחושב	דרוג מידרוג לנייר	דרוג מעלות לנייר	אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	כמות	תאור נייר
השגחה מיוחדת	8.69	0.92		N/R	0.39%	23,754.73	23,731.00	אמפא יובל אגח א
Total					0.39%	23,754.73	23,731.00	

נכון לתאריך הדוח, אין בתיק חשיפה נוספת לנכסי חוב או נכסים אחרים שהונפקו על ידי מנפיקים אלה

6,065,945

סה"כ אשראי לא מוחרג

תיאור חובות בעייתיים בתיק אשראי לא מוחרג

קופת גמל לתגמולים ולפיצויים בע"מ 60 ומעלה

התפלגות חוב בעייתי על פי ענפים

אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	תאור ענף
100.00%	23,754.73	נדל"ן מניב
100.00%	23,754.73	

התפלגות חוב בעייתי על פי קבוצת לווים

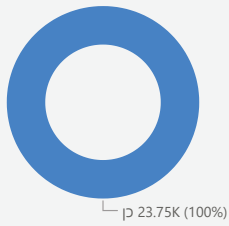
אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	תאור קבוצת לווים
100.00%	23,754.73	אמפא, יצחק ברוך
100.00%	23,754.73	

התפלגות חוב בעייתי על פי דירוג

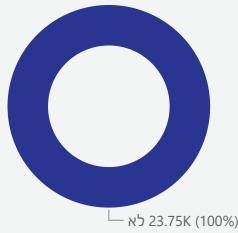
אחוז מאשראי לא מוחרג	שווי נייר	דרוג קובע לנייר
100.00%	23,754.73	N/R
100.00%	23,754.73	

נכון לתאריך הדוח, אין בתיק חשיפה נוספת לנכסי חוב או נכסים אחרים שהונפקו על ידי קבוצות הלווים הנל

התפלגות חוב בעייתי על פי סחירות



התפלגות חוב בעייתי על פי ביטחונות



התפלגות חוב בעייתי על פי חשיפה גאוגרפית

