

# נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 קבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים          | קוד   | סעיף   |
|----------------|-------|--|
|                |       | <b>א. מזומנים ושוי מזומנים בישראל</b>  |
| 108,389,041.71 | DA12  | יתרות מזומנים ועו"ש בשקלים חדשים   |
| 11,976,281.79  | DT11  | יתרות מזומנים ועו"ש נקובים במט"ח   |
| 35,574,625.28  | DA10  | פח"ק/פר"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 בחו"ל   |
|                | DT191 | יתרות מזומנים ועו"ש נקובים במט"ח חו"ל  |
|                | DT424 | פיקדונות במט"ח לתקופה של עד שלושה חודשים   |
|                |       | ב. ניירות ערך  |
|                |       | 1. אגרות חוב ממשלתיות בישראל   |
|                |       | א. סחיר  |
| 286,148,910.52 | DT13  | אגרות חוב ממשלתיות סחירות צמודות מדד   |
| 431,245,402.52 | DT15  | אגרות חוב ממשלתיות סחירות לא צמודות בריבית קבועה (שחר)                                     |
| 20,388,035.4   | DT16  | אגרות חוב ממשלתיות סחירות לא צמודות בריבית משתנה (גילון)                                   |
|                | DT14  | אגרות חוב ממשלתיות סחירות צמודות מט"ח  |
| 106,291,788.57 | DA9   | מק"מ   |
|                |       | ב. לא סחיר   |
|                | DT7   | אגרות חוב מיועדות בקופות הגמל  |
|                | DA8   | פיקדונות חשכ"ל בחו"ל   |
|                |       | א. סחיר  |
| 10,565,320.81  | DT17  | אגרות חוב של ממשלת ישראל שהונפקו בחו"ל   |
|                | DT26  | אגרות חוב סחירות שהנפיקו ממשלות זרות בחו"ל   |
|                |       | 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                                 |
|                | 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  |
|                | DT571 | תעודות חוב מסחריות לא סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות שעומדות כנגדן   |
|                | DT570 | תעודות חוב מסחריות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות שעומדות בחו"ל |

# נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 קבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים          | קוד   | סעיף  |
|----------------|-------|---|
|                |       | 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       |
|                | 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   |
|                | DT614 | תעודות חוב מסחריות לא סחירות בחו"ל חברות זרות בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות           |
|                |       | 3. אגרות חוב קונצרניות  |
|                |       | בישראל  |
|                |       | א. סחיר   |
| 80,233,178.02  | DT301 | אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מדד בדירוג (-AA) ומעלה                                    |
| 27,374,808.95  | DT303 | אגרות חוב קונצרניות סחירות לא צמודות בדירוג (-AA) ומעלה                                     |
| 1,667,113.08   | DT302 | אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מט"ח בדירוג (-AA) ומעלה                                   |
| 37,266,316.58  | DT307 | אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מדד בדירוג (-BBB:+A)                                      |
| 37,503,048.9   | DT309 | אגרות חוב קונצרניות סחירות לא צמודות בדירוג (-BBB:+A)                                       |
| 3,985,594.3    | DT308 | אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מט"ח בדירוג (-BBB:+A)                                     |
| 4,038,311.06   | DT313 | אגרות חוב קונצרניות סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות                   |
| 3,860,630.84   | DT315 | אגרות חוב קונצרניות סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות                    |
|                | 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  |
| 35,064,210.81  | DT319 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג (-AA) ומעלה                                 |
| 9,833,448.63   | DT321 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג (-AA) ומעלה                                  |
| 2,122,244.19   | DT320 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג (-AA) ומעלה                                |
| 451,506.33     | DT325 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג (-BBB:+A)                                   |
| 1,550,375.74   | DT327 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג (-BBB:+A)                                    |
|                | DT326 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג (-BBB:+A)                                  |
|                | DT553 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות שעומדות כנגדן  |
|                | DT555 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות שעומדות כנגדן   |
|                | DT554 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מט"ח בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות שעומדות כנגדן |
| 1,378,815.62   | DT337 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות                |
| 0              | DT339 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות לא צמודות בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות                 |
| 313,235.81     | 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 |
|                | DT621 | אגרות חוב קונצרניות לא סחירות אחרות בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות                     |
|                |       | בח"ל  |
|                |       | א. סחיר   |
|                | DT454 | אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג (-A) ומעלה                             |
| 1,458,871.17   | DT455 | אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג (-BBB:+BBB)                            |
| 1,877,816.83   | DT456 | אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות ישראליות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות           |
| 19,021,773.49  | DT457 | אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג (-A) ומעלה                                 |
| 109,904,352.59 | DT458 | אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג (-BBB:+BBB)                                |
| 15,393,365.72  | DT459 | אגרות חוב סחירות שהנפיקו חברות זרות בחו"ל בדירוג הנמוך מ (-BBB) או לא מדורגות               |
|                |       | ב. לא סחיר  |

# נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 קבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים          | קוד   | סעיף   |
|----------------|-------|--|
|                | 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     |
|                | 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 |
|                |       | 4. מניות   |
|                |       | בישראל   |
|                |       | א. סחיר  |
| 100,587,733.87 | DT402 | מניות השייכות למדד ת"א 35  |
| 38,037,819.4   | DT403 | מניות השייכות למדד ת"א 90  |
| 10,228,378.36  | DT404 | מניות היתר   |
| 11,394,282.28  | DT405 | מניות זרות הנסחרות בארץ  |
|                | DT172 | אופציות 001 (long)call   |
|                | DT205 | אופציות 001 (short)call  |
|                |       | ב. לא סחיר   |
| 3,609,932.35   | DC9   | מניות לא סחירות בחו"ל  |
|                |       | א. סחיר  |
| 15,474,925.12  | DT28  | מניות של חברות ישראליות שנסחרות בחו"ל  |
| 21,990,909.57  | 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  |
| 71,484,935.77  | DT83  | מניות לא סחירות של חברות זרות בחו"ל  |
|                |       | 5. השקעה בתעודות סל  |
|                |       | נסחרות בארץ  |
| 10,054,614.63  | DT360 | השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי מניות בארץ  |
| 12,532,246.62  | DT361 | השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי מניות בחו"ל   |
| 2,983,888.33   | DT362 | השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי אג"ח בארץ   |
|                | DT363 | השקעה בתעודות סל שמחקות מדדי אג"ח בחו"ל  |
|                | DT406 | השקעה בתעודות סל בחסר בארץ   |
|                | DT623 | השקעה בתעודות סל אחרות בארץ  |
|                |       | נסחרות בחו"ל   |
| 108,016,609.92 | DT366 | השקעה בתעודות סל שנסחרות בחו"ל שמחקות מדדי מניות   |
|                | DT367 | השקעה בתעודות סל שנסחרות בחו"ל שמחקות מדדי אג"ח  |
|                | DT407 | השקעה בתעודות סל בחסר בחו"ל  |
|                | DT624 | השקעה בתעודות סל אחרות בחו"ל   |
|                |       | 6. תעודות השתתפות בקרנות נאמנות  |
|                |       | בישראל   |
| 516,477.66     | DB10  | תעודות השתתפות בקרן נאמנות בחו"ל   |
|                |       | תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- אג"ח קונצרני   |
| 36,075,573.65  | DT701 | תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- אג"ח ממשלתי  |
|                | DT702 | תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- מניות  |
| 15,967,784.16  | DT703 | תעודות השתתפות בקרנות נאמנות- אחר  |
| 34,916,230.18  | DT704 | 7. קרנות השקעה   |
|                |       | בישראל   |
| 2,192,239.59   | DT53  | קרנות הון סיכון  |
| 8,459,903.46   | DT466 | קרנות גידור  |
|                | DT225 | קרנות נדל"ן  |
| 27,390,359.57  | DT52  | קרנות השקעה אחרות בחו"ל  |
|                |       | בישראל   |
| 1,025,911.79   | DT89  | קרנות הון סיכון בחו"ל  |
| 14,949,119.09  | DT467 | קרנות גידור בחו"ל  |

# נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 קבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים         | קוד   | סעיף  |
|---------------|-------|---|
| 12,921,167.64 | DT226 | קרנות נדל"ן בחו"ל   |
| 53,167,649.75 | DT88  | קרנות השקעה אחרות בחו"ל   |
|               |       | 8. כתבי אופציה (WARRANTS)   |
|               |       | בישראל  |
|               |       | א. סחיר   |
| 256,155.86    | DB5   | כתבי אופציות סחירים   |
|               |       | ב. לא סחיר  |
| 5,626.4       | DT439 | כתבי אופציה לא סחיר   |
|               |       | בחו"ל   |
|               |       | א. סחיר   |
|               | DT211 | כתבי אופציות סחירים בחו"ל   |
|               |       | ב. לא סחיר  |
| 753.88        | DT440 | כתבי אופציות לא סחירים בחו"ל                                      |
|               |       | 9. חוזים עתידיים  |
|               |       | בישראל  |
|               |       | א. סחיר   |
|               | DT749 | חוזים עתידיים סחירים - FUTURES                                    |
|               |       | ב. לא סחיר  |
| -32,957.08    | DT441 | חוזים עתידיים על מדדים כולל מניות (FORWARD, SWAP) לא סחירים       |
| 4,363,232.65  | DT442 | חוזים עתידיים על ש"ח/מט"ח (FORWARD, SWAP) לא סחירים               |
| -93,155.03    | DT443 | חוזים עתידיים על מט"ח/מט"ח (FORWARD, SWAP) לא סחירים              |
| -1,392,455.63 | DT444 | חוזים עתידיים על ריבית (FORWARD, SWAP) לא סחירים                  |
|               | DT445 | חוזים עתידיים אחרים (FORWARD, SWAP) לא סחירים                     |
|               |       | בחו"ל   |
|               |       | א. סחיר   |
| 8,368,855.53  | DT212 | חוזים עתידיים סחירים - FUTURES בחו"ל                              |
|               |       | ב. לא סחיר  |
| 488,437.56    | 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   |
| 49,984.69     | DT468 | אופציות על מדדים כולל מניות סחירות (long)                         |
| -49,631.78    | 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  |
|               | DT472 | אופציות על מדדים כולל מניות לא סחירות (short)                     |
|               | DT470 | אופציות על מדדים כולל מניות לא סחירות (long)                      |
|               | 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)                   |
| -225.21       | DT217 | אופציות על מדדים כולל מניות בחו"ל סחירות (short)                  |

## נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 כבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים        | קוד   | סעיף  |
|--------------|-------|---|
|              | 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)             |
|              | DT480 | אופציות על מדדים/נכסים בחו"ל לא סחירות (long)         |
|              | 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      |
|              | 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  |
| 4,488,515.41 | 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  |
| 2,057,380.95 | 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   |

## נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 קבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים        | קוד   | סעיף  |
|--------------|-------|---|
|              | 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<br>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                    |
|              | DT681 | מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע                     |
|              | DT682 | מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד                      |
|              | DT683 | מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר<br>מוצרים מאוגחים    |
| 3,475,151.5  | DT658 | שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (-AA) ומעלה                           |
|              | DT659 | שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (-BBB:+A)                             |
| 51,650.03    | DT660 | שכבת חוב (Tranch) בישראל בדירוג (+BB) ומטה                            |
|              | DT661 | שכבת הון (Equity Tranch) בישראל<br>בח"ל<br>א. סחיר<br>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<br>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<br>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<br>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<br>ב. לא סחיר<br>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<br>קרן לא מובטחת      |
| 1,709,097.89 | DT668 | מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי                  |
|              | DT669 | מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות                  |

# נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 קבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים          | קוד   | סעיף  |
|----------------|-------|---|
|                | 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  |
|                | DT673 | מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר 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  |
|                |       | <b>מוצרים מאוגחים</b>   |
|                | 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 (BB+) ומטה   |
|                | DT677 | שכבת הון (Equity Tranch) בחו"ל  |
|                |       | ג. הלוואות בישראל   |
|                |       | הלוואות לעמיתים   |
| 48,741,033.24  | DC1   |   |
| 102,645,076.53 | DT502 | תיקי משכנתאות בדירוג (BBB-) ומעלה, או שעומדת כנגדם בטוחה מספקת, או משכנתא ראשונה על         |
|                | DT503 | תיקי משכנתאות בדירוג הנמוך מ (BBB-)   |
| 2,100,408.98   | 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                                 |
| 147,220,288.07 | DT451 | הלוואות מובטחות בביטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג (AA-) ומעלה                  |
| 244,506,619.11 | 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         |
| 20,430,423.14  | DT507 | הלוואות מובטחות בביטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות |
|                | DT577 | הלוואות לא מובטחות בחו"ל  |
|                | DT508 | תיקי משכנתאות בחו"ל שעומדת כנגדם בכל עת בטוחה מספקת, או משכנתא ראשונה על זכות               |
|                | DT509 | הלוואות בחו"ל מובטחות בערבות בנקאית   |
| 43,262,720.43  | 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                    |
| 620,481.1      | DT514 | פיקדונות נקובים במט"ח בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה                 |
|                | DT515 | פיקדונות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד שנה                   |
| 5,796,419.3    | DT516 | פיקדונות צמודות מדד בדירוג (AA-) ומעלה לתקופה של מעל שנה                                    |
| 4,544,929.36   | 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 מדד 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 מדד 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 מדד בדירוג (BBB+A) לתקופה של מעל שנה  |
|                | DT530 | פיקדונות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד      |
|                | 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    |
|                | DT533 | פיקדונות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שלושה חודשים ועד      |
|                | DT534 | פיקדונות צמודות מדד בדירוג הנמוך מ (BBB-) או לא מדורגות לתקופה של מעל שנה                   |



## נכסים ותזרים מנכסים

לחודש 02/2019 גמל  
 קבוצה: הראל גמל אג"ח עד 20% מניות כולל שיקוף (7349)  
 מספר אישור 502  
 גרסת דוח: דוח לאוצר 2017  
 קוד קופת הגמל: 502

| נכסים           | קוד   | סעיף   |
|-----------------|-------|--|
|                 | 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 |
| 18,430,568.25   | DT111 | זכויות במקרקעין מניבים   |
|                 | DT112 | זכויות במקרקעין לא מניבים בחו"ל  |
| 8,959,433.62    | DT113 | זכויות במקרקעין מניבים בחו"ל   |
|                 | DT114 | זכויות במקרקעין לא מניבים בחו"ל ו. השקעות אחרות בישראל                                   |
|                 | DT116 | התחייבויות בגין מכירה 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 בניני משרדים ששימוש הקופה   |
|                 | DT115 | רכוש קבוע שאינו בניני משרדים, בניכי פחת נצבר   |
|                 | DT62  | ח. חייבים זכאים שונים  |
| 1,695,629.04    | DT54  | חייבים שונים   |
| -8,204,522.52   | DT55  | זכאים  |
| -237,626        | DT92  | זכאים מס הכנסה   |
|                 | DT353 | עמיתים זכאים בגין החזרי מס   |
|                 | DT369 | עמיתים זכאים בגין שיקים שמועד פרעונם עבר   |
|                 |       | ט. תקבולים ותשלומים אחרים הנובעים מנכסים הפרשי שער                                       |
|                 |       | דמי השאלה מהשאלות ניירות ערך   |
|                 |       | ריבית פיגורים בגין איחור בהעברת כספי עמיתים  |
|                 |       | ריבית פיגורים בגין חובות מעבידים   |
|                 |       | ריבית פיגורים בגין אחור במשיכת כספים   |
|                 |       | מס הכנסה בגין רווחי השקעות של הקופה  |
|                 |       | מס שבח   |
| 2,683,115,417.3 | DE1   | סה"כ נכסי הקופה  |
|                 |       | סה"כ תקבולים מתזרים מנכסים   |
|                 |       | סה"כ תשלומים מתזרים מנכסים   |