

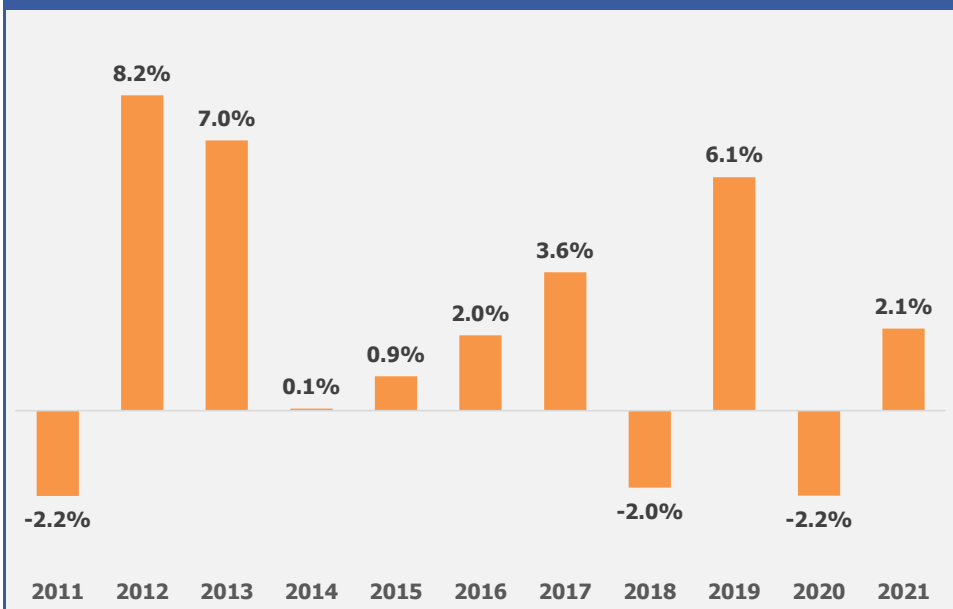
אינדקס קונצרני מדורג 2-5 שנים

index
Research and Development

המידע נכון לתאריך: 02/05/21

המדד כולל איגרות חוב קונצרניות בריבית קבועה, שקליות וצמודות מדד (בסיס ההצמדה מאוזן במועד הקובע), שדירוגן לפחות (BBB-), בעלות תקופת פידיון של שנתיים עד 5 שנים

ביצועי המדד



אודות המדד

תאריך השקה:	01/04/2015
התחלת נתונים היסטוריים:	01/04/2010
ערך מדד הבסיס:	100
אופן חישוב המדד:	GTR
תדירות פרסום:	רציף
תדירות עדכון הרכב:	חודשית
אופן קביעת משקולות:	שווי שוק
מגבלת משקל סדרה:	1.25%
מגבלת משקל תאגיד:	12%

תנאי סף לסדרות במדד

סוג ריבית:	קבועה בלבד
סוג הצמדה:	שקלי או מדד
שווי שוק מינימלי:	100 מיליון ₪
דירוג אשראי:	BBB- ומעלה
מועד פדיון:	2-5 שנים

ניתוח ביצועים היסטוריים

תשואה מצטברת בתקופה			סטיית תקן*			שארף*		
2021	שנה	3 שנים	5 שנים	שנה	3 שנים	5 שנים	שנה	3 שנים
2.1%	6.5%	3.7%	8.4%	3.8%	6.2%	4.9%	1.8	0.2

* החישוב בוצע על בסיס נתונים יומיים ומוצג במונחים שנתיים. חישוב מדד שארף מתבסס על ריבית בנק ישראל כריבית חסרת סיכון

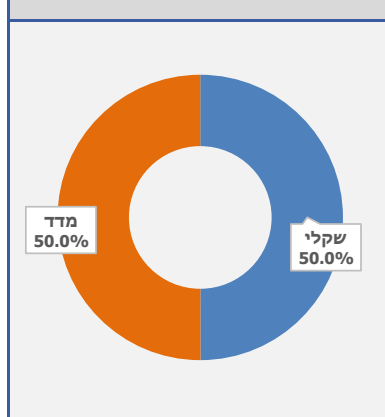
נתוני מדד עדכניים

מספר ניירות במדד:	151
מח"מ ברוטו:	2.52
תשואה לפד' ברוטו:	1.84%
דירוג אשראי ממוצע:	AA-

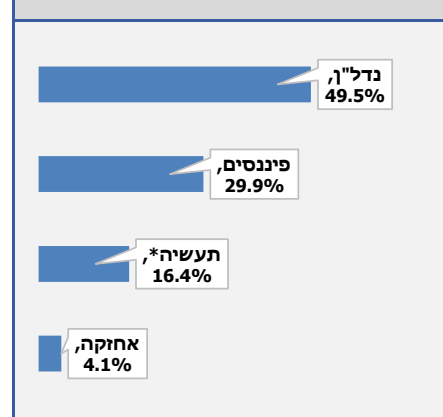
התפלגות אשראי

קב' AAA	11.90%
קב' AA	45.01%
קב' A	38.35%
קב' BBB	4.74%
אג"ח HY*	---

התפלגות הצמדה



התפלגות ענפית



* אג"ח קונצרניות שאינן מדורגות ו/או מתחת לדירוג השקעה

בסיס ההצמדה מאוזן במועד הקובע לעדכון המדד

* אג"ח מענפי תעשייה, מסחר ושירותים, טכנולוגיה, אנרגיה וחיפוי גז

מדד אינדקס קונצרני מדורג 2-5 שנים נערך ומחושב על ידי אינדקס מחקר ופיתוח מדידים בע"מ (להלן ולעיל: "אינדקס"). כל הזכויות הנוגעות למדד שייכות לאינדקס. כל הנתונים המופיעים במסמך זה מובאים לצרכי מידע בלבד והם משקפים ביצועי עבר אשר אינם מהווים בהכרח את ביצועי ההשקעה בפועל לאור קיום עלויות מסחר, מיסוי ותקבולים שאינם מקבלים ביטוי במחירי ניירות הערך הנכללים במדד. אין לראות בתוצאות העבר ניסיון לחזות את התוצאות בעתיד. בנוסף, יודגש כי חלק מהמידע המוצג לעיל מבוסס על חישובים תיאורטיים בלבד ולא על ביצועי השוק בפועל. החישובים התיאורטיים מבוססים על מתודולוגיה זוה לז של המדד במועד השקתו הרשמית. בנוסף, המידע עלול לכלול אי דיוקים וטעויות וייתכן שחלו במידע המובא לעיל שינויים מאז פרסומו. אינדקס לא תהא אחראית בכל צורה שהיא לנזק או הפסד שיגרמו משימוש במידע המופיע במסמך זה, אם יגרמו, ואינה מתחייבת כי שימוש במידע זה עשוי ליצור רווחים בידי המשתמש. אין לראות במידע המופיע במסמך זה המלצה לבצוע פעולות השקעה ו/או תחליף ליעוץ/שיעור השקעות האמור להינתן באופן פרטי על פי צרכי המשקיע ו/או תחליף לשקול דעתו העצמאית של הקורא. מדי ניירות ערך אינם מהווים מכשירי השקעה ולא ניתן להשקיע בהם באופן ישיר. אינדקס עוסקת בניתוח ובפיתוח, חישוב ועריכת מדידי ניירות ערך למגוון צרכי השקעה ואינה מנהלת, מאשרת, משוקקת או מקדמת מכשירי השקעה על המדדים שהיא עורכת ו/או מחשבת. השימוש במדדי אינדקס לצורך יצירת מכשירי השקעה מחייב התקשרות ברשיון עם אינדקס. שמות המדדים הינם סימנים מסחריים של אינדקס אשר ניתנים לשימוש על ידי מנהלים של מכשירי השקעה במסגרת רישיון בתוקף. אין לבצע כל שימוש בסימנים המסחריים של אינדקס ללא אישור מראש ובכתב מאינדקס. מסמך זה הינו רכוש של אינדקס. אין להעתיק, לשכפל, לצטט ו/או לפרסם מסמך זה, או כל חלק ממנו ללא קבלת אישור בכתב ומראש. כל הזכויות שמורות.