

פסגות תעודות סל בע"מ
פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
פסגות תעודות התחייבות מט"ח בע"מ
(החברה")

28 יולי 2010

לכבוד
הבורסה לני"ע בת"א בע"מ
רחוב אחד העם 54
תל-אביב 65202

לכבוד
רשות ניירות ערך
רחוב כנפי נשרים 22
ירושלים 95464

ג.א.ג.

הנדון: דו"ח מיידי – שווי הוגן במוצרי מדדים

הערות כלליות:

- א. המחלק (K) הינו מספר קבוע ביחס לכל סדרה בנפרד המייצג תרגום של נקודות מדד לשווי כספי.
- ב. עמלת ההמרה המצויינת בטבלאות להלן אינה נגבית בדרי"כ במקרה של המרה כפויה ואינה נלקחת בחשבון בחישוב השווי ההוגן של התעודה.
- ג. את הנוסחאות המפורטות להלן יש לקרוא משמאל לימין.
- ד. השווי ההוגן מעוגל לאגורה הקרובה ביותר.
- ה. השווי ההוגן של התעודה לאחר חישוב דמי ניהול, ריבית צבורה או דיבידנד צבור, לפי העניין, אך ללא עמלת המרה. השווי ההוגן מחושב לפי שער המדד לייחוס ושער המטבע לייחוס המפורטים בטבלה. יצויין כי השווי בהמרה ייקבע לפי שער המדד ושער המטבע לייחוס כפי שמפורט בנוסחת ההמרה של התנאים של כל תעודה, שכוללים ציטוטים של שער המדד ושער המטבע במועדים שנקבעו בתשקיפי ההנפקה ביחס לכל סדרה בנפרד.
- ו. חישוב שער המדד לייחוס לגבי מדדים ישראליים: השער משקף את שער הנעילה של המדד בבורסה. לגבי מדדים בחו"ל: השער משקף את שער הסגירה בתום יום מסחר בחו"ל, כלומר בשעה השונה משעת חישוב שער הנעילה בארץ.
- ז. שער המטבע לייחוס הינו השער היציג הידוע.
- ח. הדיבידנד הצבור הינו נכון לסוף יום המסחר האחרון.
- ט. מקדם דמי הניהול שבטבלה משקף את דמי הניהול שנגבו עד ליום הקודם ליום דיווח זה.
- י. המידע בדיווח מיידי זה הינו מידע תמציתי הנכון למועד הדיווח. השווי ההוגן המחושב בדיווח זה אינו מהווה מצג כל שהוא של החברה ביחס למחיר נייר הערך ו/או התמורה שתתקבל בהמרתו, שתקבע על-פי תנאי נייר הערך בלבד. על השוקל השקעה בניירות הערך המפורטים בדיווח זה מומלץ לקרוא את תשקיף ההנפקה של נייר הערך ודיווחיה השונים של החברה, כמו גם את תנאי נייר הערך המלאים המפורטים בשטר הנאמנות.

1. תעודות של על מדדי מניית/אנ"ח בישראל

שוי הוגן של התעודה בסוף יום המסחר האחרון(באגורות)	רכיבים לצורך הצבה בנוסחת שווי הוגן				נתונים כללים								
	דיבידנד/ריבית צבורה (בנק' מדד)	דיבידנד / ריבית צבורים (באגורות)	מקדם דמי ניהול	שער מדד לייחוס	עמלת המרה	מחלק (K)	דמי ניהול בשיעור שנתי (באחוזים)	מסבע לייחוס	מדד לייחוס	מס' ני"ע	תעודה	סדרה	שם חברה מנפיקה
1122.7	0.00000	0.00000	1	1122.69	0.35%	100	0%	ש	ת"א-25	1084656	פסגות 25	א	פסגות תעודות של בני"מ
772.7	0.00000	0.00000	0.992507	778.49	0.75%	100	0.5%	ש	ת"א-75	1113307	פסגות 75	יז	פסגות תעודות של מדדים בעי"מ
1037.5	0.00000	0.00000	1	1037.47	0.35%	100	0%	ש	ת"א-100	1096593	פסגות 100	ג	פסגות תעודות של בני"מ
1231.3	0.00000	0.00000	0.981603	1254.33	0.10%	100	0.5%	ש	תל-דיב 20	1099506	פסגות 20	יז	פסגות תעודות של בני"מ
277.1	0.00000	0.00000	0.996370	278.09	0.50%	100	0.5%	ש	ת"א נדל"ן-15	1115740	פסגות 15	יח	פסגות תעודות של מדדים בעי"מ
390.0	0.00000	0.00000	0.997507	391.01	1.00%	100	1.0%	ש	יתר-50	1118769	פסגות 50	כ	פסגות תעודות של מדדים בעי"מ
823.8	0.00000	0.00000	0.989841	832.22	1.00%	100	0.9%	ש	יתר-ת"א	1114263	פסגות 100	יט	פסגות תעודות של מדדים בעי"מ
263.3	0.000000	0.00000	0.990540	265.82	0.70%	100	0.30%	ש	תל-בונד 20	1104603	פסגות 20	א	פסגות תעודות של מדדים בעי"מ
1165.4	0.000000	0.00000	0.985847	1182.16	0.15%	100	0.45%	ש	ת"א-בנקים	1104645	פסגות בנקים	ה	פסגות תעודות של מדדים בעי"מ
252.1	0.000000	0.00000	0.989337	254.8	0.50%	100	0.40%	ש	גילונים	1107945	פסגות גילונים	יא	פסגות תעודות של מדדים בעי"מ

שוי הוגן של התעודה בסוף יום המסחר האחרון(באגורות)	רכיבים לצורך הצבה בנוסחת שווי הוגן				נתונים כללים								
	דיבידנד/ריבית צבורה (בנק' מדד)	דיבידנד / ריבית צבורים (באגורות)	מקדם דמי ניהול	שער מדד לייחוס	עמלת המרה	מחלק (K)	דמי ניהול בשיעור שנתי (באחוזים)	מטבע לייחוס	מדד לייחוס	מס' ני"ע	תעודה	סדרה	שם חברה מפיקה
2535.15	0.000000	0.000000	0.993201	255.25	0.70%	10	0.35%	ש	תל-בונד 40	1109412	פסגות סל בונד 40	יבי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
2592.26	0.000000	0.000000	0.993201	261	0.70%	10	0.35%	ש	תל-בונד 60	1109420	פסגות סל בונד 60	ימי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
262.76	0.000000	0.000000	1.000000	262.76	0.70%	100	0.00%	ש	תל-בונד שקלי	1116326	פסגות סל בונד שקלי	סאי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
2836.78	0.000000	0.000000	0.990356	286.44	0.35%	10	0.40%	ש	שחר 0-2	1109438	פסגות סל שחר 0-2	ידי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
3298.08	0.000000	0.000000	0.990356	333.02	0.35%	10	0.40%	ש	שחר 2-5	1109446	פסגות סל שחר 2-5	טרי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
3722.55	0.000000	0.000000	0.990356	375.88	0.35%	10	0.40%	ש	שחר +5	1109453	פסגות סל שחר +5	סזי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
227.88	0.000000	0.000000	0.993501	229.37	0.40%	100	0.40%	ש	גליל 0-2	1112853	פסגות סל גליל 0-2	כבי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
245.43	0.000000	0.000000	0.993501	247.04	0.40%	100	0.40%	ש	גליל 2-5	1112861	פסגות סל גליל 2-5	כני	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
261.38	0.000000	0.000000	0.998564	261.76	0.40%	100	0.40%	ש	גליל 5-10	1118389	פסגות סל גליל 5-10	מחי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
253.25	0.000000	0.000000	1.000000	253.25	0.30%	100	0.00%	ש	מקי"מ	1112879	פסגות סל מקי"מ	כדי	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ

נוסחה לחישוב שווי הוגן של תעודת סל באגורות:

דיבידנד או ריבית צבורים באגורות+100*מקדם דמי ניהול' K/מדד

שם חברה מנפיקה	סדרה	תעודה	מס' ני"ע	מדד לייחוס (טיקר בבלומברג)	מטבע לייחוס	דמי ניהול בשיעור שנתי (באחוזים)	מחלק (K)	עמלת המרה	שער מדד לייחוס	שער מטבע לייחוס	רכיבים לצורך הצבה בנוסחת שווי הוגן			שווי הוגן של התעודה בסוף יום המסחר האחרון(באגור וט)
											מקדם דמי ניהול	דיבידנד צבור (באגורות)/מקדם ריבית צבורה	דיבידנד / ריבית צבורה (בנק' מדד)	
פסגות תעודות של בע"מ	ד'	פסגות של טיגר	1096601	DJTGR	דולר	1.0%	10	0.25%	434.25	3.8020	0.984329	0.00000	0.00000	16251
פסגות תעודות של בע"מ	ה'	פסגות של גלובל	1096619	DJGT	דולר	1.0%	10	0.25%	159.94	3.8020	0.984329	4.18220	0.11000	5990
פסגות תעודות של בע"מ	ו'	פסגות של אנרגיה	1096627	DJTENG	דולר	1.0%	10	0.50%	387.53	3.8020	0.989288	0.00000	0.00000	14576
פסגות תעודות של בע"מ	ז'	פסגות של דיבידנד ארה"ב	1096635	DJDVP	דולר	1.0%	10	0.25%	332.54	3.8020	0.984329	10.32623	0.27160	12455
פסגות תעודות של בע"מ	ח'	פסגות של סחורות	1096650	DBLCMACL	דולר	0.0%	100	0.25%	349.2446	3.8020	1	1.00961	0.00000	1341
פסגות תעודות של בע"מ	יב'	פסגות של דיבידנד אירופה	1099522	SD3E	אירו	0.8%	100	0.40%	1690.86	4.9599	0.970542	4.60626	0.92870	8144
פסגות תעודות של בע"מ	יג'	פסגות של דיבידנד יפן	1099530	DJPSDT	יפן	1.2%	10	0.80%	201.29	4.3563	0.955814	0.00000	0.00000	8381
פסגות תעודות של בע"מ	יד'	פסגות של STARS	1099548	CSTARSGD	דולר	1.0%	10	0.40%	155.48	3.8020	0.963178	0.00000	0.00000	5694

שם חברה תעודת סל מדדים בע"מ	סדרה	תעודה	מס' ני"ע	מדד לייחוס (טיקר בבלומברג)	מטבע לייחוס	דמי ניהול בשיעור שנתי (באחוזים) (K)	מחלק המרה	עמלת המרה	שער מדד לייחוס	שער מטבע לייחוס	מקדם דמי ניהול	רכיבים לצורך הצבה בנוסחת שווי הוגן		שווי הוגן של התעודה בסוף יום המסחר האחרון(באגור ות)
												דיבידנד צבור (באגורות)/מקדם ריבית צבורה	דיבידנד / ריבית צבורה (בנק' מדד)	
פסגות תעודת סל בע"מ	טו	פסגות סל נדל"ן אירופה	1099555	EPRA	אירו	1.0%	100	0.40%	1270.67	4.9599	0.963178	0.00000	0.00000	6070
פסגות תעודת סל מדדים בע"מ	ג	פסגות סל דיבידנד אסיה	1104629	DJASDT	דולר	1.25%	100	0.80%	930.90	3.8020	0.960685	0.00000	0.00000	3400
פסגות תעודת סל מדדים בע"מ	ד	פסגות סל דיבידנד סקנדינביה	1104637	SD2G	אירו	1.10%	1000	0.40%	2803.08	4.9599	0.965403	0.00000	0.00000	1342
פסגות תעודת סל מדדים בע"מ	ו	פסגות סל דיבידנד גרמניה	1107895	DJESDT	אירו	1%	100	0.40%	255.53	4.9599	0.973123	0.00000	0.00000	1,233
פסגות תעודת סל מדדים בע"מ	ז	פסגות סל דיבידנד קנדה	1107903	DJCASDT	דולר קנדי	1%	100	0.40%	304.46	3.7064	0.973315	0.00000	0.00000	1098
פסגות תעודת סל מדדים בע"מ	ח	פסגות סל דיבידנד אוסטרליה	1107911	DJAUSDT	דולר אוסטרלי	1%	100	0.40%	332.87	3.445	0.973123	0.00000	0.00000	1116
פסגות תעודת סל מדדים בע"מ	ט	פסגות סל דיבידנד עולמי	1107929	SDGV	דולר	1%	1000	0.40%	3478.13	3.8020	0.973123	0.00000	0.00000	1287
פסגות תעודת סל מדדים בע"מ	י	פסגות סל ברזיל	1107937	IBOV	ריאל ברזילאי	1%	1000	0.80%	66674.44	2.1574	0.973315	0.00000	0.00000	14001

נוסחה לחישוב שווי הוגן של תעודת סל באגורות:

דיבידנד צבור באגורות+100*מקדם דמי ניהול *שער מטבע לייחוס *K/מדד

נוסחה לחישוב שווי הוגן של תעודת סחורה באגורות (סדרה ח):

100*מקדם ריבית צבורה*מקדם דמי ניהול *שער מטבע לייחוס *100/מדד

שוי הוגן של התעודה בסוף יום המסחר האחרון (באגורות)	רכיבים לצורך הצבה בנוסחת שווי הוגן				נתונים כללים								
	ריבית צבורה (באגורות)	מקדם ריבית צבורה	מקדם דמי ניהול	שער מטבע לייחוס	שיעור ריבית שנתית (באחוזי) (ס)	עמלת המרה	מכפיל	דמי ניהול בשיעור שנתי (באחוזים)	מטבע לייחוס	מס' ני"ע	תעודה	סדרה	שם חברה מנפיקה
38,020	-	10000.00	1	3.8020	Libor - 1W 0.35%	0.10% (מיני 36 דולר)	100	0.0%	דולר/ש	1089481	פסגות מט"ח דולר	א	פסגות תעודות התחייבות מט"ח בע"מ
49,603	4.17	10000.84	1	4.9599	Libor - 1W 0.35%	0.05% (מיני 36 אירו)	100	0.0%	אירו/ש	1089499	פסגות מט"ח אירו	ב	פסגות תעודות התחייבות מט"ח בע"מ

נוסחה לחישוב שווי הוגן של תעודות התחייבות באגורות:

מקדם ריבית צבורה ישער מטבע לייחוס

5. תעודות של מנטרלות חשיפה מטבעית

שוי הוגן של התעודה בסוף יום המסחר האחרון (באגורות)	רכיבים לצורך הצבה בנוסחת שוי הוגן						נתונים כללים									
	דיבידנד / ריבית צבורה (בנק' מדד)	דיבידנד צבור (באגורות)	מקדם דמי ניהול	מקדם ריבית צבורה	מרווח ריבית	ריבית לייחוס	שער מדד לייחוס	עמלת המרה	מחלק (K)	דמי ניהול בשיעור שנתי (באחוזים)	מטבע לייחוס	מדד לייחוס (טיקר בבלומברג)	מס' ני"ע	תעודה	סדרה	שם חברה מנפיקה
11,249	14.84030	148.40300	0.994499	1.002195	0.25%	Libor \$ 1W	1113.84	0.50%	10	0.8%	ש	SPX	1116060	פסגות סל S&P	מז'	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ

100 * מקדם דמי ניהול * מקדם ריבית צבורה * K / (דיבידנד בנקודות מדד + מדד)

6. תעודות של על מדדי חו"ל - REINVEST

שוי הוגן של התעודה בסוף יום המסחר האחרון (באגורות)	רכיבים לצורך הצבה בנוסחת שוי הוגן						נתונים כללים							
	דיבידנד / ריבית צבורה (בנק' מדד)	דיבידנד צבור (באגורות)/מקדם ריבית צבורה	מקדם דמי ניהול	שער מטבע לייחוס	שער מדד לייחוס	עמלת המרה	מחלק (K)	דמי ניהול בשיעור שנתי (באחוזים)	מטבע לייחוס	מדד לייחוס (טיקר בבלומברג)	מס' ני"ע	תעודה	סדרה	שם חברה מנפיקה
4264	12.01442	45.678825	0.996126	3.8020	1113.84	0.50%	100	0.7%	דולר	SPX	1117399	פסגות סל S&P	מז'	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
7185	3.21800	12.234836	0.998767	3.8020	1888.81	0.50%	100	0.5%	דולר	NDX	1118801	פסגות סל נאסדק	מז'	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ
8906.16	290.09670	141.248083	0.995014	0.4869	18093.12	0.50%	100	1.0%	דולר הונג קונג	XIN0I	1117563	פסגות סל סין	מז'	פסגות תעודות סל מדדים בע"מ

100 * מקדם דמי ניהול * שער מטבע לייחוס * K / (דיבידנד בנקודות מדד + מדד)