v1 **פסגות חברה לביטוח**

דו"ח חודשי , שיעורי ההשקעות ורכוש קבוע מסך כל ההתחייבויות לתקופה שנסתיימה ביום : 31.3.17

הסכומים באלפי ש"ח

		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
								ביטוח חיים			
	חזרה	סה"כ משותף ברווחים	קרן ח'	קרן ט'	פסגות-כללי	פסגות-אג"ח עד 10% מניות	פסגות-אג"ח	פסגות-מניות	פסגות-פאסיבי כללי	פסגות-פאסיבי מדדי מניות	פסגות-הלכה	פסגות-אג"ח עד 20% במניות	פסגות כספי	פסגות חו"ל
שורה					8638	8568	8569	8570	8571	8572	8573	9456	9458	9457
10	**1. השקעות**	**671,796**			**311,706**	**165,149**	**39,581**	**34,706**	**23,870**	**10,710**	**14,355**	**61,769**	**3,104**	**6,847**
11	**א. מזומנים ושווי מזומנים**	**21,483**			**11,492**	**3,997**	**1,459**	**994**	**528**	**329**	**391**	**1,822**	**166**	**304**
12	**1) בישראל**	**21,483**			**11,492**	**3,997**	**1,459**	**994**	**528**	**329**	**391**	**1,822**	**166**	**304**
13	א) יתרות מזומנים ועו"ש בשקלים חדשים	362									362			
14	ב) יתרות מזומנים ועו"ש נקובים במט"ח	2,092			1,423	448	30	91	16	29		16		39
15	ג) פח"ק/פר"י	19,029			10,069	3,549	1,459	964	438	313		1,806	166	265
24	**ב. ניירות ערך (למעט בחברות מוחזקות)**	**647,760**			**297,447**	**161,255**	**38,106**	**33,780**	**23,528**	**10,391**	**13,984**	**59,785**	**2,940**	**6,545**
25	**1) אגרות חוב ממשלתיות:**	**208,062**			**71,045**	**67,881**	**21,719**		**4,047**		**13,972**	**22,265**	**2,940**	**4,194**
26	**א) בישראל**	**203,868**			**71,045**	**67,881**	**21,719**		**4,047**		**13,972**	**22,265**	**2,940**	
27	**(1) סחיר**	**203,868**			**71,045**	**67,881**	**21,719**		**4,047**		**13,972**	**22,265**	**2,940**	
28	(א) צמוד מדד	75,526			23,724	26,898	11,162		229		7,513	6,001		
29	(ג) לא צמוד בריבית קבועה	125,403			47,321	40,983	10,557		3,818		6,459	16,264		
32	(ו) מק"מ	2,940											2,940	
36	**ב) בחו"ל**	4,194												4,194
37	**(1) סחיר**	4,194												4,194
38	(א) ממשלת ישראל שהונפקו בחו"ל													
39	(ב) שהנפיקה ממשלה זרה	4,194												4,194
96	**3) אג"ח קונצרני:**	**214,439**			**115,991**	**69,450**	**11,748**					**17,251**		
97	**א) בישראל**	**204,940**			**106,492**	**69,450**	**11,748**					**17,251**		
98	**(1) סחיר**	**204,940**			**106,492**	**69,450**	**11,748**					**17,251**		
99	**(א) דרוג AA- ומעלה**	**119,326**			**61,788**	**39,224**	**6,327**					**11,987**		
100	a צמוד מדד	80,735			44,995	23,807	3,568					8,365		
101	b לא צמוד	38,591			16,793	15,417	2,759					3,622		
104	**(ב) דרוג BBB- ועד A+**	**85,615**			**44,704**	**30,225**	**5,421**					**5,264**		
105	a צמוד מדד	53,012			27,516	19,710	2,790					2,995		
106	b לא צמוד	32,137			16,910	10,364	2,595					2,268		
107	c צמוד מט"ח	466			279	151	35							
135	**ב) בחו"ל**	**9,498**			**9,498**									
145	**(3) סחיר - חברות זרות**	**9,498**			9,498									
146	(א) דרוג A- ומעלה	1,065			1,065									
147	(ב) דרוג BBB- ועד BBB+	8,233			8,233									
148	(ג) דרוג נמוך מ- BBB- או לא מד	200			200									
155	**4) מניות (למעט חברות מוחזקות)**	**58,099**			**42,992**	**4,820**		**7,068**				**3,218**		
156	**א) בישראל**	**57,750**			**42,643**	**4,820**		**7,068**				**3,218**		
157	**(1) סחיר**	**57,750**			**42,643**	**4,820**		**7,068**				**3,218**		
158	(א) ת"א 35	47,941			35,710	3,883		5,847				2,501		
159	a מניות	47,941			35,710	3,883		5,847				2,501		
162	(ב) ת"א 90	9,498			6,729	907		1,175				687		
163	(ג) מניות היתר	310			204	31		46				30		
166	**ב) בחו"ל**	**349**			**349**									
167	**(1) סחיר**	**349**			**349**									
168	(א) חברות ישראליות	349			349									
175	**5) השקעות בתעודות סל**	**155,893**			**60,831**	**19,104**	**4,639**	**26,712**	**16,960**	**8,244**		**17,052**		**2,351**
176	**א) בישראל**	**108,714**			**35,142**	**15,467**	**4,639**	**18,494**	**13,857**	**5,728**		**14,732**		**655**
177	**(1)** שמחקות מדדי מניות בארץ	16,727			207	1,993		7,074	3,300	2,277		1,876		
178	**(2)** שמחקות מדדי מניות בחו"ל	61,716			34,935	5,221		11,420	1,839	3,452		4,194		655
179	**(3)** שמחקות מדדי אג"ח בארץ	30,271				8,253	4,639		8,718			8,662		
183	**ב) בחו"ל**	47,180			25,689	3,637		8,218	3,103	2,516		2,320		1,696
184	**(1)** שמחקות מדדי מניות	47,180			25,689	3,637		8,218	3,103	2,516		2,320		1,696
189	**6) תעודות השתתפות בקרנות נאמנות**	**11,151**			**6,496**				**2,509**	**2,146**				
190	א) בישראל	4,655			0				2,509	2,146				
191	ב) בחו"ל	6,496			6,496									
192	(1) אג"ח קונצרני	6,306			6,306									
193	(2) אג"ח ממשלתי													
194	(3) מניות	190			190									
217	**9) חוזים עתידיים**	**119**			**92**				**12**		**15**			
218	**א) בישראל**	**110**			**92**				**12**		**6**			
219	**(1) סחיר (Future) - ביטחון הנדרש ירשו**													
220	**(2) לא סחיר (Forward, Swap)**	**110**			**92**				**12**		**6**			
221	(א) מדדים כולל מניות													
222	(ב) מ"ז / מט"ח	110			92				12		6			
226	**ב) בחו"ל**	**9**									**9**			
227	**(1) סחיר (Future) - ביטחון הנדרש ירשו**	9									9			
234	**10) אופציות - (OPTIONS)**	**-6**									**-6**			
235	**א) בישראל**	**-6**									**-6**			
236	**(1) סחיר**	**-6**									**-6**			
237	(א) מדדים כולל מניות (Long)	-6									-6			
494	**7. השקעות אחרות**	**2,553**			**2,766**	**-103**	**16**	**-68**	**-186**	**-10**	**-20**	**162**	**-2**	**-2**