

אלטשולר שחם פנסיה כל _____ מספר אישור 1329	
דוח חודשי לחודש 12/2011	
דו"ח נכסים	
נכסים	
סכום באלפי ש"ח	
א. מזומנים ושווי מזומנים	
בישראל	
258.566	מזומן בש"ח
63.310	מזומן מט"ח
135.381	פרי / פחק
0.000	פקמ לתקופה של עד שלושה חודשים
0.000	פקדון צמוד מדד לתקופה של עד שלושה חודשים
0.000	פקדון צמוד מט"ח לתקופה של עד שלושה חודשים
0.000	פקדון במט"ח לתקופה של עד שלושה חודשים
בחו"ל	
0.000	מזומן מט"ח
0.000	פקדון לתקופה של עד שלושה חודשים בחול
ב. ניירות ערך	
1. אגרות חוב ממשלתיות	
בישראל - סחיר	
1,161.796	ממשלתי צמוד
0.000	ממשלתי צמוד מט"ח
1,455.076	ממשלתי לא צמוד קבוע
0.000	ממשלתי לא צמוד משתנה
0.000	מק"מ
בישראל - לא סחיר	
0.000	אג"ח מיועדות מרון
0.000	אג"ח מיועדות ערד (ריבית 4.86%)
0.000	אג"ח מיועדות ערד (ריבית 5.05%)
0.000	אג"ח מיועדות
0.000	פקדונות חשכל
בחו"ל - סחיר	
0.000	ממשלתי בחו"ל
436.433	ממשלתי זר בחו"ל
בחו"ל - לא סחיר	
0.000	ממשלתי לא סחיר בחו"ל
0.000	ממשלתי זר לא סחיר בחו"ל
תעודות חוב מסחריות	
בישראל - סחיר	
0.000	תעודות חוב צמוד מדד בדרוג AA- ומעלה
0.000	תעודות חוב צמוד מט"ח בדרוג AA- ומעלה
0.000	תעודות חוב לא צמוד בדרוג AA- ומעלה
0.000	תעודות חוב צמוד מדד בדרוג A+:BBB-
0.000	תעודות חוב צמוד מט"ח בדרוג A+:BBB-
0.000	תעודות חוב לא צמוד בדרוג A+:BBB-
0.000	תעודות חוב צמוד מדד בדרוג בדרוג נמוך
0.000	תעודות חוב צמוד מט"ח בדרוג בדרוג נמוך
0.000	תעודות חוב לא צמוד בדרוג בדרוג נמוך
בישראל - לא סחיר	
0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מדד AA- ומעלה
0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח AA- ומעלה
0.000	תעודות חוב ל"ס לא צמוד AA- ומעלה
0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מדד A+:BBB-
0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח A+:BBB-
0.000	תעודות חוב ל"ס לא צמוד A+:BBB-

0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מדד דרוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	תעודות חוב ל"ס לא צמוד דרוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מדד דרוג נמוך
0.000	תעודות חוב ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך
0.000	תעודות חוב ל"ס לא צמוד דרוג נמוך
	בחול"ל - סחיר
0.000	תעודות חוב סחירות בחול"ל בדירוג A- ומעלה חברות ישראליות
0.000	תעודות חוב סחירות בחול"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות ישראליות
0.000	תעודות חוב סחירות בחול"ל בדירוג נמוך חברות ישראליות
0.000	תעודות חוב סחירות בחול"ל בדירוג A- ומעלה חברות זרות
0.000	תעודות חוב סחירות בחול"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות זרות
0.000	תעודות חוב סחירות בחול"ל בדירוג נמוך חברות זרות
	בחול"ל - לא סחיר
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג A- ומעלה חברות ישראליות
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות ישראליות
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג נמוך עם בטוחה מספקת חברות ישראליות
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג נמוך חברות ישראליות
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג A- ומעלה חברות זרות
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג BBB+:-BBB חברות זרות
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג נמוך עם בטוחה מספקת חברות זרות
0.000	תעודות חוב לא סחירות בחול"ל בדירוג נמוך חברות זרות
	3. אגרות חוב קונצרניות סחירות
	בישראל - סחיר
239.423	אג"ח קונצרני צמוד מדד בדרוג AA- ומעלה
0.000	אג"ח קונצרני צמוד מט"ח בדרוג AA- ומעלה
91.174	אג"ח קונצרני לא צמוד בדרוג AA- ומעלה
0.000	אג"ח קונצרני אחרות בדרוג AA- ומעלה
445.193	אג"ח קונצרני צמוד מדד בדרוג A+:-BBB
0.000	אג"ח קונצרני צמוד מט"ח בדרוג A+:-BBB
98.991	אג"ח קונצרני לא צמוד בדרוג A+:-BBB
0.000	אג"ח קונצרני אחרות בדרוג A+:-BBB
0.000	אג"ח קונצרני צמוד מדד בדרוג נמוך
11.508	אג"ח קונצרני צמוד מט"ח בדרוג נמוך
9.414	אג"ח קונצרני לא צמוד בדרוג נמוך
0.000	אג"ח קונצרני אחרות בדרוג נמוך
	בישראל - לא סחיר
612.970	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מדד AA- ומעלה
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מט"ח AA- ומעלה
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס לא צמוד AA- ומעלה
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס אחרות AA- ומעלה
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מדד A+:-BBB
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מט"ח A+:-BBB
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס לא צמוד A+:-BBB
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס אחרות A+:-BBB
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מדד דרוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס לא צמוד דרוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס אחרות דרוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מדד דרוג נמוך
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס צמוד מט"ח דרוג נמוך
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס לא צמוד דרוג נמוך
0.000	אג"ח קונצרני ל"ס אחרות דרוג נמוך
	בחול"ל - סחיר
0.000	אג"ח ישראליות סחירות בחול"ל בדירוג A- ומעלה
0.000	אג"ח ישראליות סחירות בחול"ל בדירוג BBB+:-BBB
0.000	אג"ח ישראליות סחירות בחול"ל בדירוג נמוך
708.745	אג"ח זרות סחירות בחול"ל בדירוג A- ומעלה
220.507	אג"ח זרות סחירות בחול"ל בדירוג BBB+:-BBB
0.000	אג"ח זרות סחירות בחול"ל בדירוג נמוך
	בחול"ל - לא סחיר
0.000	אג"ח ישראליות לא סחירות בחול"ל בדירוג A- ומעלה
0.000	אג"ח ישראליות לא סחירות בחול"ל בדירוג BBB+:-BBB
0.000	אג"ח ישראליות לא סחירות בחול"ל בדירוג נמוך עם בטוחה מספקת
0.000	אג"ח ישראליות לא סחירות בחול"ל בדירוג נמוך

0.000	חוזים עתידיים על ריבית
-1.496	חוזים עתידיים אחרים
	בחו"ל - סחיר
10.775	חוזים עתידיים סחירים בחו"ל
	בחו"ל - לא סחיר
0.000	חוזים עתידיים על מדדים כולל מניות בחו"ל
0.000	חוזים עתידיים על מטח בחו"ל
0.000	חוזים עתידיים על ריבית בחו"ל
1.458	חוזים עתידיים אחרים בחו"ל
	10. אופציות
	בישראל - סחיר
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות
0.000	אופציות על מטבעות
0.000	אופציות על ריבית
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות (short)
0.000	אופציות על מטבעות (short)
0.000	אופציות על ריבית (short)
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר (short)
	בישראל - לא סחיר
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות
0.000	אופציות על ש"ח/מט"ח
0.000	אופציות על מט"ח/מט"ח
0.000	אופציות על ריבית
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות (short)
0.000	אופציות על ש"ח/מט"ח (short)
0.000	אופציות על מט"ח/מט"ח (short)
0.000	אופציות על ריבית (short)
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר (short)
	בחו"ל - סחיר
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות בחול
0.000	אופציות על מטבעות בחול
0.000	אופציות על ריבית בחול
0.000	אופציות על סחורות בחול
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר בחול
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות בחול (short)
0.000	אופציות על מטבעות בחול (short)
0.000	אופציות על ריבית בחול (short)
0.000	אופציות על סחורות בחול (short)
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר בחול (short)
	בחו"ל - לא סחיר
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות בחול
0.000	אופציות על מטבעות בחול
0.000	אופציות על ריבית בחול
0.000	אופציות על סחורות בחול
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר בחול
0.000	אופציות על מדדים כולל מניות בחול (short)
0.000	אופציות על מטבעות בחול (short)
0.000	אופציות על ריבית בחול (short)
0.000	אופציות על סחורות בחול (short)
0.000	אופציות על על מדד/נכס אחר בחול (short)
	11. מוצרים מובנים
	בישראל
	סחיר
	א. קרן מובטחת
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר
	ב. קרן לא מובטחת
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי
0.000	מוצרים מובנים בישראל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות

0.000	פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס אחר
	ד. מוצרים מאוגחים
0.000	שכבת חוב (Tranch) בדירוג AA- ומעלה בחו"ל
0.000	שכבת חוב (Tranch) בדירוג BBB- ועד A+ ומעלה בחו"ל
0.000	שכבת חוב (Tranch) בדירוג BB+ ומעלה בחו"ל
0.000	שכבת הון (Equity Tranch) בחו"ל
	לא סחיר
	א. קרן מובטחת
10.035	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אשראי
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מניות
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס ריבית
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מטבע
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס מדד
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן מובטחת ונכס בסיס אחר
	ב. קרן לא מובטחת
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אשראי
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מניות
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס ריבית
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מטבע
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס מדד
0.000	מוצרים מובנים בחו"ל עם קרן לא מובטחת ונכס בסיס אחר
	ג. פיקדונות מובנים
0.000	פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס אשראי
0.000	פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מניות
0.000	פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס ריבית
0.000	פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מטבע
0.000	פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס מדד
0.000	פיקדונות מובנים בחו"ל עם נכס בסיס אחר
	ד. מוצרים מאוגחים
0.000	שכבת חוב (Tranch) בדירוג AA- ומעלה בחו"ל
0.000	שכבת חוב (Tranch) בדירוג BBB- ועד A+ ומעלה בחו"ל
0.000	שכבת חוב (Tranch) בדירוג BB+ ומעלה בחו"ל
0.000	שכבת הון (Equity Tranch) בחו"ל
	ג. הלוואות
	בישראל
0.000	הלוואה לעמיתים
0.000	תיקי משכנתאות בדירוג BBB- ומעלה
0.000	תיקי משכנתאות בדירוג נמוך
0.000	הלוואה עם ערבות בנקאית בדירוג AA- ומעלה
0.000	הלוואה עם ערבות בנקאית בדירוג A+:BBB-
0.000	הלוואה עם ערבות בנקאית ללא דרוג
0.000	הלוואה בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג AA- ומעלה
22.436	הלוואה בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה בדירוג A+:BBB-
0.000	הלוואות בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה לא מדורגת עם בטוחה מספקת
98.351	הלוואות בבטחונות אחרים והלוואות עם ערבות מדינה לא מדורגת
0.000	הלוואות לא מובטחות
	בחו"ל
0.000	תיקי משכנתאות בחו"ל
0.000	הלוואות בחו"ל בערבות בנקאית
0.000	הלוואות בחול מובטחות בביטוח אחרים
65.632	הלוואות בחול לא מובטחות
	ד. פיקדונות לתקופה העולה על שלושה חודשים מיום ההנפקה
	בישראל
0.000	פקדונות צמודי מדד בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות לא צמודים בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות צמודי מט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות צמודי מדד בדירוג AA- ומעלה לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות לא צמודים בדירוג AA- ומעלה לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות צמודי מט"ח בדירוג AA- ומעלה לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות אחרים בדירוג AA- ומעלה
0.000	פקדונות צמודי מדד בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות לא צמודים בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה

0.000	פקדונות צמודי מט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות צמודי מדד בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות לא צמודים בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות צמודי מט"ח בדירוג A+:BBB- לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות אחרים בדירוג A+:BBB-
0.000	פקדונות צמודי מדד בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות לא צמודים בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות צמודי מט"ח בדירוג נמוך לתקופה של שלושה חודשים ועד שנה
0.000	פקדונות צמודי מדד בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות לא צמודים בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות צמודי מט"ח בדירוג נמוך לתקופה של למעלה משנה
0.000	פקדונות אחרים בדירוג נמוך
	בחו"ל
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג A- ומעלה
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג BBB+:BBB-
0.000	פקדונות נקובים במט"ח בדירוג נמוך
	ה. מקרקעין
0.000	מקרקעין מניבים
0.000	מקרקעין לא מניבים
0.000	מקרקעין מניבים בחו"ל
0.000	מקרקעין לא מניבים בחו"ל
	ו השקעות אחרות
0.000	התחייבות בגין מכירה בחסר
0.000	נ"ע סחירים אחרים ישראלים בחו"ל
0.000	נ"ע סחירים אחרים זרים בחו"ל
0.000	התחייבות בגין מכירה בחסר בחול
	ז. רכוש קבוע
0.000	בניני משרדים שבשימוש הקופה
0.000	רכוש קבוע שאינו בניני משרדים בשימוש הקופה
	ח. חייבים וזכאים
0.000	חייבים שונים
-1.472	זכאים
-2.088	זכאים מס הכנסה
0.000	עמיתים זכאים בגין החזרי מס
0.000	עמיתים זכאים בגין שיקים שמועד פרעונם עבר
0.000	סך ההתחייבויות הממשלתיות בגין אי העלאת גיל הפרישה לנשים
	ט. אחרים
0.000	הפרשי שער
0.000	דמי השאלה
0.000	ריבית פיגורים בגין איחור בהעברת זכויות עמיתים
0.000	ריבית פיגורים בגין חובות מעבידים
0.000	מס הכנסה בגין רווחי השקעות
0.000	מס שבח
8,233.446	סה"כ נכסי הקופה