# אינדקס שקלי A-AAA פיזור רחב

המידע נכון לתאריך: 01/10/2026

המדד כולל איגרות חוב ישראליות שקליות בריבית קבועה בטווח דירוג שבין (A-) לבין (AAA), כאשר במועד הקובע משקל סדרת אג"ח במדד נקבע על פי 3 פקטורים: יחס שוטף של מנפיק האג"ח, תזרים מזומנים מפעילות שוטפת ומרווח ממשלתי

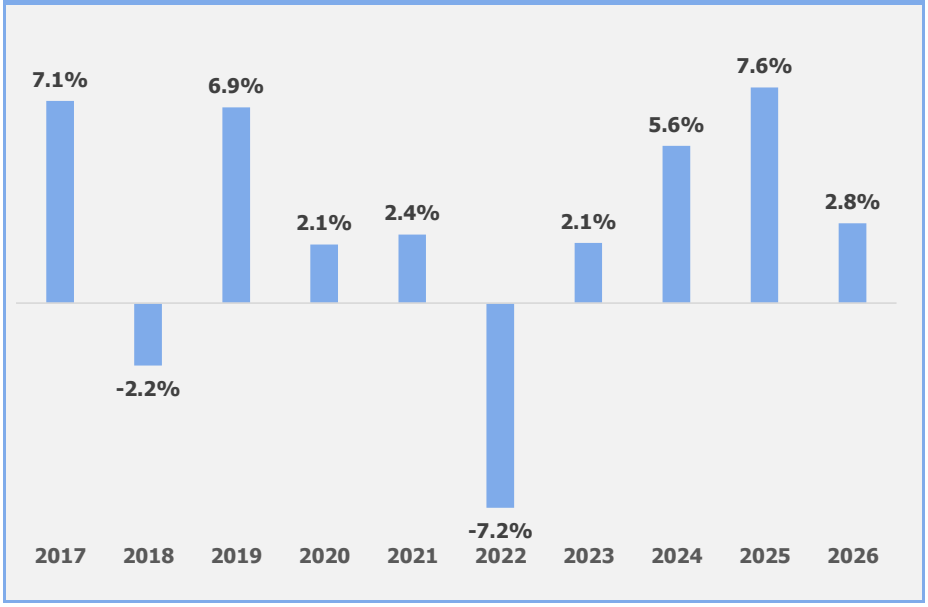
## אודות המדד

| | |
|---|---|
| תאריך השקה: | 18/09/2023 |
| התחלת נתונים היסטוריים: | 31/03/2015 |
| ערך מדד הבסיס: | 100 |
| אופן חישוב המדד: | GTR |
| תדירות פרסום: | רציף |
| תדירות עדכון הרכב: | חודשית |
| אופן קביעת משקולות: | שווי שוק |
| מגבלת משקל סדרה: | 1.00% |
| מגבלת משקל תאגיד: | 5.0% |

## תנאי סף לסדרות במדד

| | |
|---|---|
| סוג ריבית: | קבועה |
| סוג הצמדה: | שקלי |
| סוג מנפיק: | קונצרני |
| דירוג אשראי: | A- ומעלה |
| טווח פדיון/מח"מ: | שנה ומעלה |

## ביצועי המדד




## נתוני מדד עדכניים

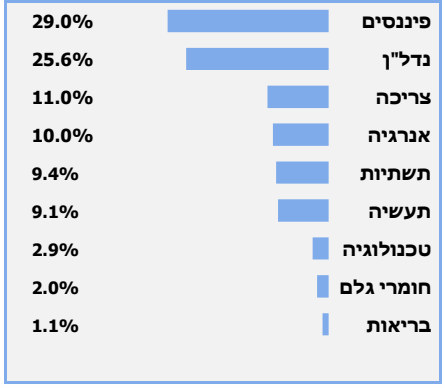
| | |
|---|---|
| מספר ניירות במדד: | 202 |
| מח"מ ברוטו: | 3.67 |
| תשואה לפד' ברוטו: | 4.66% |
| דירוג אשראי ממוצע: | AA- |

## ניתוח ביצועים היסטוריים

| תשואה מצטברת בתקופה | | | | סטיית תקן* | | | שארפ* | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2026 | שנה | 3 שנים | 5 שנים | שנה | 3 שנים | 5 שנים | שנה | 3 שנים | 5 שנים |
| 2.8% | 4.9% | 21.0% | 11.5% | 2.1% | 3.0% | 3.7% | 1.3 | 1.1 | -0.1 |

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

## התפלגות ענפית




## התפלגות הצמדה

## התפלגות אשראי

| | |
|---|---|
| קב' AAA | 8.59% |
| קב' AA | 40.38% |
| קב' A | 51.02% |
| קב' BBB | --- |
| אג"ח HY* | --- |

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


מדד אינדקס שקלי A-AAA פיזור רחב נערך ומחושב על ידי אינדקס מחקר ופיתוח מדדים בע"מ (להלן ולעיל: "אינדקס"). כל הזכויות הנגזרות מהמדד 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 זהה לזו 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 לביצוע פעולות השקעה ו/או תחליף לייעוץ/שיווק השקעות האמור להינתן באופן פרטני על פי צרכי המשקיע ו/או תחליף לשיקול דעתו העצמאי של הקורא. מדדי ניירות ערך אינם מהווים מכשירי השקעה ולא ניתן להשקיע בהם באופן ישיר. אינדקס עוסקת בניתוח ובפיתוח, חישוב ועריכת מדדי ניירות ערך למגוון צרכי השקעה ואינה מנהלת, מאשרת, משווקת או מקדמת מכשירי השקעה על המדדים שהיא עורכת ו/או מחשבת. השימוש במדדי אינדקס לצורך יצירת מכשירי השקעה מחייב התקשרות ברישיון 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 רכושה של אינדקס. אין להעתיק, לשכפל, לצטט ו/או לפרסם מסמך זה, או כל חלק ממנו ללא קבלת אישור בכתב ומראש. כל הזכויות שמורות.