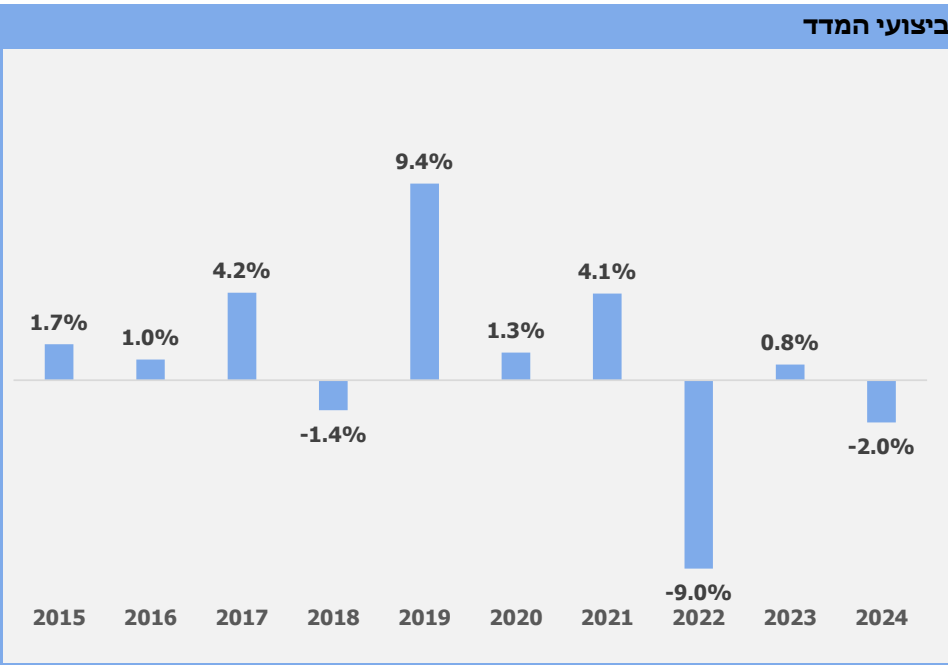


המדד כולל איגרות חוב ממשלתיות שקליות וצמודות מדד בריבית קבועה, כאשר במועד הקובע ניתן פקטור משקל עודף לסדרות אג"ח בהתאם לבסיס ההצמדה שלהן וזאת ע"פ הפער שבין האינפלציה הגלומה בשוק לאינפלציה הגלומה הממוצעת ב-12 החודשים האחרונים



אודות המדד

| | |
|-------------------------|------------|
| תאריך השקה: | 11/07/2021 |
| התחלת נתונים היסטוריים: | 31/12/2013 |
| ערך מדד הבסיס: | 100 |
| אופן חישוב המדד: | GTR |
| תדירות פרסום: | רציף |
| תדירות עדכון הרכב: | חודשית |
| אופן קביעת משקולות: | שווי שוק |
| מגבלת משקל סדרה: | 100.00% |
| מגבלת משקל תאגיד: | --- |

תנאי סף לסדרות במדד

| | |
|------------------|-------------|
| סוג ריבית: | קבועה |
| סוג הצמדה: | שקלי או מדד |
| סוג מנפיק: | ממשלתי |
| דירוג אשראי: | --- |
| טווח פדיון/מח"מ: | שנה ומעלה |

ניתוח ביצועים היסטוריים

| שארפ* | | | סטיית תקן* | | | תשואה מצטברת בתקופה | | | |
|--------|--------|------|------------|--------|------|---------------------|--------|-------|-------|
| 5 שנים | 3 שנים | שנה | 5 שנים | 3 שנים | שנה | 5 שנים | 3 שנים | שנה | 2024 |
| -0.5 | -1.2 | -1.2 | 3.9% | 4.1% | 4.9% | -3.1% | -8.1% | -2.1% | -2.0% |

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

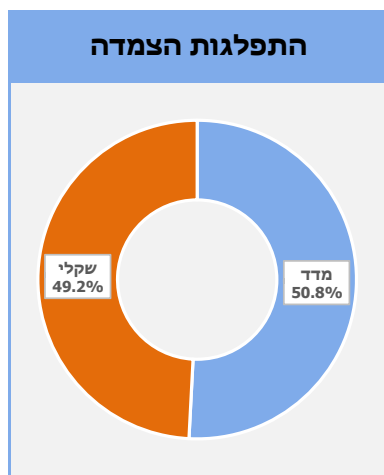
נתוני מדד עדכניים

| | |
|--------------------|-------|
| מספר ניירות במדד: | 25 |
| מח"מ ברוטו: | 7.65 |
| תשואה לפד' ברוטו*: | 4.68% |
| דירוג אשראי ממוצע: | AAA |

* סדרות צמודות חשבו בתוספת האינפלציה הגלומה בשוק

התפלגות אשראי

| | |
|---------|------------|
| 100.00% | ממשלתי/AAA |
| --- | קב' AA |
| --- | קב' A |
| --- | קב' BBB |
| --- | אג"ח HY* |



התפלגות ענפית

| | |
|--------|--------|
| 100.0% | ממשלתי |
|--------|--------|

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

מדד אינדקס מדינה מנגנון שקלי-צמוד נערך ומחושב על ידי אינדקס מחקר ופיתוח מדדים בע"מ (להלן ולעיל: "אינדקס"). כל הזכויות הנתונות ממוגנות בסיבות 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 תראה אחראית בכל צורה שהיא לנוק או הפסד שגרמו 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 ליעוץ/שיווק השקעות האמור להינתן באופן פרטי 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, משוקקת 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 רכשה של אינדקס. אין להעתיק, לשכפל, לצטט ו/או לפרסם מסמך זה, או כל חלק ממנו ללא קבלת אישור בכתב ומראש. כל הזכויות שמורות.