

לוח ג'נ'16

ההתפתחות של קרנות הנאמנות¹ מגן וחשיפה, 1999 עד 2003
(אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

הרכב תיק הנכסים (סוף תקופה)																
אחוזים							יתרות									
שיעור תשואה ³ נומינלי כולל על כל הנכסים	סך כל המקורות לפעילות ²	נכסים פיננסיים לא-צמוד	מניות עתידיים בארץ	מניות וני"ע להמרה	השקעות בחו"ל	צמוד למט"ח ונקוב	צמוד במט"ח למדד בארץ	צמוד למט"ח ונקוב	נכסים פיננסיים עתידיים לא-צמוד			צמוד למט"ח ונקוב			נכסי הקרנות (ערך שוק, סוף תקופה)	התקופה
									מניות	ני"ע	השקעות בחו"ל	מניות	ני"ע	השקעות בחו"ל		
9.8	-489	99	1	0	0	0	0	921	13	1	0	2	0	937	1999	
5.6	-270	99	1	0	0	0	0	701	5	2	0	0	0	708	2000	
8.0	232	88	2	2	0	8	0	396	10	7	0	37	1	451	2001	
14.1	967	94	1	0	0	5	0	1,313	20	0	0	71	0	1,404	2002	
11.1	331	96	1	0	1	2	0	1,840	13	0	22	32	1	1,908	2003	
2002																
2.3	222	89	1	1	0	9	0	607	8	7	0	61	1	684	ינואר	
0.8	169	94	1	0	0	5	0	804	6	3	0	44	0	857	פברואר	
1.6	452	95	1	1	0	3	0	1,288	13	7	0	39	1	1,348	מארס	
2.5	124	95	1	1	0	3	0	1,404	16	11	0	51	1	1,483	אפריל	
1.6	310	94	1	0	0	5	0	1,700	18	7	0	93	0	1,818	מאי	
0.8	78	94	1	0	0	5	0	1,789	26	2	0	95	1	1,913	יוני	
-0.5	-292	95	0	0	0	5	0	1,525	-2	0	0	83	1	1,607	יולי	
0.3	-133	93	1	0	0	6	0	1,373	12	1	0	92	0	1,478	אוגוסט	
0.2	-4	92	1	0	0	7	0	1,291	16	4	0	104	0	1,415	ספטמבר	
-0.7	26	91	1	0	0	8	0	1,306	9	2	0	113	0	1,430	אוקטובר	
1.2	-64	92	0	0	0	8	0	1,271	2	1	0	108	0	1,382	נובמבר	
3.4	79	94	1	0	0	5	0	1,313	20	0	0	71	0	1,404	דצמבר	
2003																
1.6	144	86	1	0	1	12	0	1,342	17	0	21	190	0	1,570	ינואר	
0.6	68	93	0	0	2	5	0	1,532	8	0	27	82	0	1,649	פברואר	
0.5	-38	94	0	0	2	4	0	1,515	7	0	25	68	0	1,615	מארס	
0.7	-68	88	0	0	1	11	0	1,360	1	0	23	169	0	1,553	אפריל	
1.0	-43	90	0	0	1	9	0	1,371	3	0	21	143	0	1,538	מאי	
0.2	-8	96	0	0	1	3	0	1,469	-4	0	16	49	0	1,530	יוני	
0.3	10	95	0	0	1	4	0	1,473	4	0	15	54	0	1,546	יולי	
0.0	53	92	0	0	1	7	0	1,468	2	0	15	115	-1	1,599	אוגוסט	
2.1	42	95	1	0	1	3	0	1,604	9	0	12	47	0	1,672	ספטמבר	
1.0	74	97	0	0	1	2	0	1,697	7	1	20	40	0	1,765	אוקטובר	
0.8	123	94	0	0	1	5	0	1,783	9	0	20	89	1	1,902	נובמבר	
1.7	-25	96	1	0	1	2	0	1,840	13	0	22	32	1	1,908	דצמבר	

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת כפי שפורסמה בתשיפי הקרנות. קרן מגן - קרן המשקיעה 5-10 אחוזים מנכסיה באופציות מעו"ף ואת היתר בנכסים שקליים.

(2) עודף ההנפקות על הפדיונות בניכוי דיבידנד במזומן.

(3) החל מחודש מארס 1995 חושב שיעור התשואה בהתבסס על מחיר הפדיון של הקרן. המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית של בנק ישראל.