

לוח ג'נ-17

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 1999 עד 2003
(אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											מגן וחיפה סך הכול
מדד	אג"ח ²	75% אג"ח מדינה	מט"ח	מניות ³	ח"ל ⁴	שקלי	מעורבות	גמישות	מגן וחיפה	סך הכול	
א. סך כל הנכסים											
1999	289	2,899	2,122	2,854	7,621	1,724	14,033	1,127	2,313	937	35,919
2000	221	2,678	1,944	2,255	6,929	2,115	26,003	1,056	1,923	708	45,832
2001	590	6,107	3,631	6,009	5,537	4,121	34,563	648	1,355	451	63,012
2002	459	3,298	2,232	6,116	2,833	7,168	21,253	352	725	1,404	45,840
2003	443	5,283	4,322	5,171	6,668	11,744	45,873	463	1,289	1,908	83,164
2002											
ינואר	1,287	11,553	7,075	6,980	5,442	5,890	35,110	707	1,397	684	76,125
פברואר	1,654	12,727	8,633	7,243	4,970	6,557	33,479	674	1,282	857	78,076
מרץ	1,329	10,270	6,750	7,647	4,555	7,421	31,115	634	1,212	1,348	72,281
אפריל	1,307	8,708	5,895	8,193	4,269	8,123	27,913	599	1,136	1,483	67,626
מאי	1,469	8,196	5,624	8,022	4,200	9,146	25,517	585	1,113	1,818	65,690
יוני	1,179	6,283	4,550	6,722	3,763	9,215	21,311	526	998	1,913	56,460
יולי	899	5,250	3,905	5,830	3,621	7,650	20,812	503	956	1,607	51,033
אוגוסט	752	4,735	3,474	5,573	3,555	7,218	20,401	487	921	1,478	48,594
ספטמבר	667	4,325	3,047	5,948	3,190	7,265	19,092	434	837	1,415	46,220
אוקטובר	585	3,790	2,690	5,999	2,879	7,163	18,389	393	766	1,430	44,084
נובמבר	531	3,645	2,592	5,696	3,254	7,048	19,046	397	829	1,382	44,420
דצמבר	459	3,298	2,232	6,116	2,833	7,168	21,253	352	725	1,404	45,840
2003											
ינואר	448	3,302	2,199	6,296	2,697	7,662	21,166	342	705	1,570	46,387
פברואר	456	3,387	2,162	6,479	2,714	7,802	21,125	338	700	1,649	46,812
מרץ	440	3,323	2,216	6,291	2,912	7,542	22,191	340	737	1,615	47,607
אפריל	421	3,321	2,216	6,155	3,512	7,262	23,641	359	852	1,553	49,292
מאי	408	3,331	2,399	6,226	4,117	7,277	25,791	375	940	1,538	52,402
יוני	440	5,226	2,683	6,292	4,745	6,944	27,947	391	1,010	1,530	57,208
יולי	440	5,197	2,736	6,662	4,384	7,433	29,739	382	975	1,546	59,494
אוגוסט	439	5,070	2,743	6,778	4,148	7,656	30,998	374	957	1,599	60,762
ספטמבר	445	5,112	2,915	6,468	4,268	8,087	34,303	380	989	1,672	64,639
אוקטובר	446	4,967	3,414	6,478	4,881	9,139	37,073	401	1,093	1,765	69,657
נובמבר	456	5,316	3,845	6,325	6,061	9,821	40,696	448	1,248	1,902	76,118
דצמבר	443	5,283	4,322	5,171	6,668	11,744	45,873	463	1,289	1,908	83,164

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת שפורסמה בתשקיפי הקרנות.

(2) קבוצות התמחות אג"ח ואג"ח-להמרה.

(3) התמחות במניות כללי, מעו"ף ואופציות.

(4) קרנות לתושבי חוץ, קרנות חו"ל וני"ע ישראלים בחו"ל.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית של בנק ישראל.

לוח ג'-נ'-17 (המשך 1)
הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2001 עד 2003
(אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											
מגן וחשיפה סך הכול	מעורבות גמישות	מט"ח	מניות ³	חוב ⁴	שקלי	75% אג"ח מדינה	אג"ח ²	ממד			
ב. הרכב תיק הנכסים											
2001											
526	11	45	8	80	95	160	32	35	55	5	מספר הקרנות לטוף התקופה
6.3	0.1	1.5	6.2	0.1	0.1	0.1	0.0	55.9	22.8	79.7	ההשקעות בארץ
9.5	8.3	3.5	11.8	0.0	30.7	0.7	65.7	5.1	6.1	0.6	צמודות למדד
11.9	1.6	68.7	51.3	0.0	8.0	86.1	1.4	3.1	14.6	3.8	מט"ח ונסחרות במט"ח
0.4	2.2	0.9	0.3	0.1	0.0	0.6	2.5	0.1	0.2	0.0	מניות וני"ע בני המרה
67.7	87.8	18.6	25.7	99.8	7.5	8.2	29.9	35.7	55.3	15.9	נכסים פיננסיים עתידיים
4.2	0.0	6.8	4.7	0.0	53.7	4.3	0.5	0.1	1.0	0.0	נכסים לא-צמודים
											ההשקעות בחו"ל
2002											
584	12	41	7	105	121	148	37	45	63	5	מספר הקרנות לטוף התקופה
5.6	0.1	2.7	7.5	0.0	0.0	0.1	0.0	53.5	30.0	79.7	ההשקעות בארץ
12.3	5.0	3.3	14.5	-0.1	10.1	0.8	73.4	4.3	5.4	0.5	צמודות למדד
8.5	0.0	56.9	47.5	0.0	1.3	88.3	1.2	2.7	16.7	3.1	מט"ח ונסחרות במט"ח
0.3	1.4	0.7	0.1	0.0	0.1	0.3	1.4	0.2	0.1	0.0	מניות וני"ע בני המרה
59.0	93.5	27.2	25.7	100.1	2.9	7.1	22.0	38.6	45.2	16.7	נכסים פיננסיים עתידיים
14.3	0.0	9.2	4.7	0.0	85.6	3.4	2.0	0.7	2.6	0.0	נכסים לא-צמודים
											ההשקעות בחו"ל
2003											
648	11	41	6	141	134	155	39	53	63	5	מספר הקרנות לטוף התקופה
6.7	-0.1	3.3	17.8	0.0	0.0	0.4	0.0	54.2	49.6	85.9	ההשקעות בארץ
5.7	1.7	2.8	14.6	0.1	10.6	0.3	59.2	1.6	3.2	0.3	צמודות למדד
9.9	0.0	64.3	43.5	0.3	2.0	86.8	1.7	3.4	15.3	3.8	מט"ח ונסחרות במט"ח
0.2	0.7	0.9	0.0	0.0	0.0	1.3	2.3	0.0	-0.8	0.1	מניות וני"ע בני המרה
64.9	96.5	17.3	19.0	99.6	8.1	8.4	23.5	40.4	31.1	9.7	נכסים פיננסיים עתידיים
12.6	1.2	11.4	5.1	0.0	79.3	2.8	13.3	0.4	1.6	0.2	נכסים לא-צמודים
											ההשקעות בחו"ל

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת שפורסמה בתשקיפי הקרנות.
 (2) קבוצות התמחות אג"ח ואג"ח-להמרה.
 (3) התמחות במניות כללי, מעו"ף ואופציות.
 (4) קרנות לתושבי חוץ, קרנות חו"ל וני"ע ישראלים בחו"ל.
 המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית של בנק ישראל.

לוח ג'-נ' 17- (המשך 2)

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 1999 עד 2003
(אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											התקופה
מגן וחשיפה סך הכול	מעורבות גמישות	שקלי	חור"ל ⁴	מניות ³	מט"ח	75% אג"ח מדינה ²	אג"ח ²	מדד	ג. סך המקורות לפעילות ⁵		
7,157	-489	169	-39	5,076	265	1,523	930	-273	132	-137	1999
11,002	-270	37	-6	9,982	1,076	1,352	-594	-252	-254	-69	2000
15,398	232	-328	-187	5,568	2,001	-265	3,275	1,593	3,168	341	2001
-14,911	967	-281	-191	-12,980	2,713	-1,146	-321	-1,019	-2,538	-115	2002
30,671	331	183	24	21,497	2,851	1,973	524	1,544	1,793	-49	2003
12,366	222	61	53	231	1,730	56	663	3,368	5,298	684	ינואר 2002
2,677	169	-39	-16	-1,540	724	-153	283	1,617	1,257	375	פברואר
-4,993	452	-17	-19	-1,979	721	-90	179	-1,687	-2,252	-301	מארס
-4,556	124	-28	-23	-2,948	430	-77	354	-834	-1,525	-29	אפריל
-2,346	310	-33	-18	-2,352	834	-115	-218	-322	-572	140	מאי
-7,251	78	-52	-32	-3,653	310	-180	-955	-812	-1,707	-248	יוני
-5,344	-292	-29	-22	-842	-1,214	-130	-776	-681	-1,073	-285	יולי
-2,513	-133	-32	-16	-483	-444	-65	-241	-428	-522	-149	אוגוסט
-1,875	-4	-30	-20	-902	-95	-109	115	-378	-370	-82	ספטמבר
-1,754	26	-36	-28	-765	-35	-146	184	-357	-510	-87	אוקטובר
-518	-64	-5	-16	182	-90	52	-152	-154	-210	-61	נובמבר
1,196	79	-42	-34	2,071	-158	-189	243	-351	-353	-70	דצמבר
241	144	-9	-9	-148	252	-63	111	-44	23	-16	ינואר 2003
109	68	-9	-8	-203	158	-14	135	10	-32	4	פברואר
511	-38	22	-6	641	-92	52	25	27	-105	-15	מארס
1,033	-68	39	-1	1,097	-171	210	54	-39	-67	-21	אפריל
2,095	-43	12	0	1,743	-171	228	246	146	-47	-19	מאי
4,427	-8	24	5	1,856	-162	447	188	231	1,824	22	יוני
2,352	10	7	-3	1,759	331	-79	222	84	15	6	יולי
1,124	53	-11	-5	1,072	203	-143	83	2	-129	-1	אוגוסט
3,050	42	6	-2	2,944	259	-42	-272	118	-4	1	ספטמבר
3,745	74	26	7	2,501	778	204	-91	227	20	-1	אוקטובר
5,638	123	65	32	3,339	699	814	-84	386	261	3	נובמבר
6,347	-25	10	15	4,896	767	358	-93	397	34	-12	דצמבר

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת שפורסמה בתשקיפי הקרנות.

(2) קבוצות התמחות אג"ח ואג"ח-להמרה.

(3) התמחות במניות כללי, מעו"ף ואופציות.

(4) קרנות לתושבי חוץ, קרנות חו"ל וני"ע ישראלים בחו"ל.

(5) סך כל המקורות לפעילות הם עודף הנפקות על הפדיונות בניכוי הדיבידנד במזומן.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית של בנק ישראל.

לוח ג'-נ'-17 (המשך 3)

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 1999 עד 2003
(אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											
התקופה	מדד	אג"ח ²	אג"ח 75% מדינה	מט"ח	מניות ³	חו"ל ⁴	שקלי	מעורבות גמישות	מגן וחיפה סך הכול		
ד. שיעור התשואה הנומינלי											
1999	8.1	17.8	9.8	3.4	64.3	46.4	11.5	27.3	9.8	25.2	
2000	0.8	0.8	3.6	0.8	-15.5	-13.9	9.7	-4.3	5.6	4.4	
2001	11.2	6.0	11.5	12.4	-12.5	-11.0	7.9	1.2	8.0	5.2	
2002	1.6	-1.5	-1.8	8.1	-28.1	6.6	0.7	-13.2	14.1	-0.5	
2003	8.5	13.1	12.8	-7.8	60.5	10.5	12.2	29.5	11.1	13.4	
2002											
ינואר	1.7	1.6	1.7	4.8	-2.0	0.9	0.9	1.1	2.3	1.2	
פברואר	-0.2	-0.5	-0.5	0.5	-5.8	-1.0	-0.2	-2.5	0.8	-0.8	
מרץ	-1.6	-1.6	-2.1	3.2	-5.8	1.8	-1.1	-3.1	1.6	-0.8	
אפריל	0.6	-0.5	-0.7	2.6	-4.8	3.8	-0.9	-2.0	2.5	-0.1	
מאי	1.6	0.7	0.8	0.6	1.5	2.1	-0.3	0.8	1.6	0.6	
יוני	-2.7	-2.2	-2.2	-4.1	-5.6	-1.5	-0.7	-3.8	0.8	-2.0	
יולי	0.6	0.5	0.9	-1.7	0.0	-3.5	1.6	-0.2	-0.5	0.0	
אוגוסט	0.3	0.1	-0.1	-0.2	0.0	0.2	0.3	0.0	0.3	0.2	
ספטמבר	-0.3	-1.3	-1.4	4.7	-7.0	1.8	-2.2	-3.4	0.2	-0.8	
אוקטובר	0.7	-0.6	0.0	-2.2	-5.2	-0.6	0.3	-3.0	-0.7	-0.8	
נובמבר	1.3	2.3	2.2	-2.5	11.3	-0.1	2.5	5.4	1.2	2.1	
דצמבר	-0.3	0.0	-0.4	2.7	-7.6	2.8	0.7	-2.9	3.4	0.6	
2003											
ינואר	1.0	0.6	0.6	1.1	-2.4	2.7	0.2	-0.1	1.6	0.7	
פברואר	0.7	0.7	0.9	0.6	1.5	0.7	0.7	0.9	0.6	0.7	
מרץ	0.1	1.3	1.6	-3.3	5.2	-2.1	2.0	2.6	0.5	0.8	
אפריל	0.4	2.1	1.8	-3.0	13.2	-1.1	2.1	5.9	0.7	1.9	
מאי	1.5	1.7	2.0	-2.6	10.7	2.6	1.1	4.7	1.0	1.9	
יוני	2.7	1.4	2.4	-1.9	4.5	-2.0	1.3	3.1	0.2	0.9	
יולי	-1.2	-0.8	-0.6	2.4	-5.9	2.5	0.1	-1.8	0.3	0.0	
אוגוסט	0.1	0.2	0.2	0.4	-2.0	-0.2	0.6	-0.5	0.0	0.2	
ספטמבר	1.2	1.3	1.2	-0.5	4.0	2.6	1.1	2.0	2.1	1.4	
אוקטובר	0.6	1.6	0.9	1.5	9.5	3.2	0.8	4.4	1.0	2.0	
נובמבר	1.4	1.6	1.2	-1.1	7.8	0.1	0.7	3.5	0.8	1.3	
דצמבר	-0.3	0.8	0.0	-1.7	4.0	1.2	0.7	1.6	1.7	0.9	

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת שפורסמה בתשקיפי הקרנות.

(2) קבוצות התמחות אג"ח ואג"ח-להמרה.

(3) התמחות במניות כללי, מעו"ף ואופציות.

(4) קרנות לתושבי חוץ, קרנות חו"ל וני"ע ישראלים בחו"ל.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית של בנק ישראל.