

לוח ג'-נ'-17

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2001 עד 2005
(מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											
מגן	75% אג"ח	מט"ח	מניות ³	חו"ל ⁴	שקלי	מעורבות	גמישות	וחשיפה	סך הכול		
א. סך כל הנכסים											
63,012	451	1,355	648	34,563	4,121	5,537	6,009	3,631	6,107	590	2001
45,840	1,404	725	352	21,253	7,168	2,833	6,116	2,232	3,298	459	2002
83,164	1,908	1,289	463	45,873	11,744	6,668	5,171	4,303	5,302	443	2003
101,101	1,623	2,116	857	49,537	15,693	9,500	2,730	6,695	11,989	361	2004
124,621	764	2,645	742	40,265	20,948	9,921	3,305	14,600	30,558	873	2005
89,945	1,954	1,509	495	45,956	15,647	8,131	3,480	5,426	6,868	479	ינואר 2004
91,813	2,070	1,650	560	44,713	17,186	8,620	3,554	5,616	7,339	505	פברואר
94,245	2,042	1,749	633	45,291	17,790	9,005	3,690	5,726	8,064	255	מארס
95,639	1,993	1,887	762	44,612	18,064	9,588	3,906	5,776	8,746	305	אפריל
94,997	1,966	1,901	819	43,318	17,780	9,416	3,865	6,239	9,319	374	מאי
96,412	2,214	2,051	1,005	43,709	17,196	9,986	3,662	6,434	9,787	368	יוני
95,700	2,221	1,993	1,068	44,568	16,307	9,468	3,531	6,205	9,996	343	יולי
94,419	2,100	1,789	823	45,384	15,883	8,456	3,373	6,303	9,954	354	אוגוסט
95,281	2,015	1,827	809	46,162	15,584	8,454	3,194	6,513	10,345	378	ספטמבר
95,818	2,019	1,768	782	46,781	15,608	8,002	3,120	6,721	10,618	399	אוקטובר
97,814	2,057	1,979	827	47,771	15,401	8,797	2,851	6,625	11,121	385	נובמבר
101,101	1,623	2,116	857	49,537	15,693	9,500	2,730	6,695	11,989	361	דצמבר 2004
105,846	1,601	2,309	916	50,233	15,802	10,046	2,734	7,583	14,238	384	ינואר 2005
111,135	1,532	2,532	967	50,734	15,777	10,509	2,652	8,617	17,345	470	פברואר
115,168	1,431	2,686	918	50,370	15,536	10,684	2,663	9,877	20,405	598	מארס
117,975	1,372	2,751	956	50,389	15,191	10,922	2,676	10,898	22,135	685	אפריל
122,085	1,245	2,873	937	50,464	14,768	10,919	2,705	12,489	24,863	822	מאי
122,720	1,179	2,447	765	50,321	16,639	8,832	4,155	13,374	24,153	855	יוני
125,468	1,118	2,496	781	49,275	17,227	8,998	4,204	14,731	25,688	950	יולי
128,426	1,040	2,525	790	47,785	17,373	9,211	3,960	16,613	28,053	1,076	אוגוסט
131,743	897	2,586	787	45,683	18,121	9,260	3,688	18,428	31,071	1,222	ספטמבר
132,524	850	2,601	786	43,437	18,190	9,354	3,750	19,181	33,134	1,241	אוקטובר
130,249	819	2,660	774	42,313	20,117	9,620	3,739	16,819	32,324	1,064	נובמבר
124,621	764	2,645	742	40,265	20,948	9,921	3,305	14,600	30,558	873	דצמבר 2005

(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.

לוח ג'-נ'-17 (המשך 1)

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2003 עד 2005
(אחוזים, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות										
סך הכול	מגן וחשיפה	מעורבות גמישות	שקלי	חו"ל ⁴	מניות ³	מט"ח	75% אג"ח מדינה	אג"ח ²	מדד	
ב. הרכב תיק הנכסים										
2003										
648	11	41	6	141	134	155	39	52	64	5 מספר הקרנות לסוף התקופה
ההשקעות בארץ										
6.7	-0.1	3.3	17.8	0.0	0.0	0.4	0.0	54.5	49.4	85.9 צמודות למדד
5.7	1.7	2.8	14.6	0.1	10.6	0.3	59.2	1.6	3.2	0.3 מט"ח ונסחרות במט"ח
9.9	0.0	64.3	43.5	0.3	2.0	86.8	1.7	3.3	15.3	3.8 מניות וני"ע בני המרה
0.2	0.7	0.9	0.0	0.0	0.0	1.3	2.3	0.0	-0.8	0.1 נכסים פיננסיים עתידיים
64.9	96.5	17.3	19.0	99.6	8.1	8.4	23.5	40.2	31.3	9.7 נכסים לא-צמודים
12.6	1.2	11.4	5.1	0.0	79.3	2.8	13.3	0.4	1.6	0.2 ההשקעות בחו"ל
2004										
793	11	38	8	166	200	186	31	57	94	2 מספר הקרנות לסוף התקופה
ההשקעות בארץ										
8.8	0.0	2.1	18.3	0.1	0.0	-0.1	0.3	64.6	32.9	93.6 צמודות למדד
4.7	2.7	2.1	12.9	0.1	12.3	0.6	64.1	1.5	5.2	0.0 מט"ח ונסחרות במט"ח
13.0	0.0	66.5	39.8	0.6	1.7	86.8	3.6	3.5	18.9	2.2 מניות וני"ע בני המרה
0.1	0.9	0.8	0.1	0.0	0.1	0.8	3.8	0.0	-0.7	0.0 נכסים פיננסיים עתידיים
60.4	95.6	20.3	27.4	99.2	8.6	8.9	18.3	29.9	42.0	4.2 נכסים לא-צמודים
13.0	0.8	8.2	1.5	0.0	77.3	3.0	9.9	0.5	1.7	0.0 ההשקעות בחו"ל
2005										
918	6	42	3	168	244	201	30	78	144	2 מספר הקרנות לסוף התקופה
ההשקעות בארץ										
18.2	0.0	6.1	23.3	0.7	0.1	0.3	0.3	60.7	39.8	97.1 צמודות למדד
5.2	2.9	2.8	11.8	0.3	8.8	1.0	67.1	2.4	5.6	-0.1 מט"ח ונסחרות במט"ח
13.3	0.0	67.7	45.1	0.8	1.2	83.8	2.7	3.9	16.1	1.6 מניות וני"ע בני המרה
0.1	1.0	1.2	0.0	0.0	0.0	0.4	1.1	0.0	0.0	0.0 נכסים פיננסיים עתידיים
46.9	95.5	11.8	17.8	98.0	5.8	10.1	13.1	31.6	34.5	0.8 נכסים לא-צמודים
16.3	0.6	10.4	2.0	0.2	84.1	4.4	15.7	1.4	4.0	0.6 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 המונית.

לוח ג'-נ' 17 (המשך 2)

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2001 עד 2005
(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 וחסירה	סך הכול
ג. סך המקורות לפעילות ⁵											
2001	341	3,168	1,593	3,275	-265	2,001	5,568	-187	-328	232	15,398
2002	-115	-2,538	-1,019	-321	-1,146	2,713	-12,980	-191	-281	967	-14,911
2003	-49	1,793	1,545	524	1,973	2,922	21,497	24	183	331	30,743
2004	164	5,841	2,155	-337	1,618	1,510	1,675	512	711	46	13,895
2005	490	15,807	6,859	377	-1,545	3,855	-9,189	-26	177	-815	15,990
2004	33	1,322	1,196	215	1,156	1,538	224	73	164	49	5,970
ינואר	30	536	250	74	390	1,454	-1,176	63	121	104	1,846
פברואר	7	470	-6	98	321	482	229	65	77	-25	1,718
מארס	47	826	51	158	397	345	-723	122	114	-39	1,298
אפריל	68	503	408	11	-48	-160	-1,525	62	88	-41	-634
מאי	-5	413	181	-150	143	-438	175	107	99	171	696
יוני	-27	273	-237	-137	-50	-716	809	74	25	13	27
יולי	8	-208	52	-150	-632	-448	619	-72	-140	-117	-1,088
אוגוסט	22	354	158	-124	-72	-265	627	-5	29	-93	631
ספטמבר	21	274	206	-62	-281	-142	449	-24	-35	-10	396
אוקטובר	-14	392	-115	-187	201	-166	720	36	95	20	982
נובמבר	-27	687	11	-83	92	27	1,245	11	74	16	2,053
דצמבר											
2005	19	2,033	638	-18	116	58	642	38	109	-22	3,613
ינואר	83	2,942	962	-76	116	-139	333	40	143	-69	4,335
פברואר	128	2,938	1,245	11	233	-64	-472	53	159	-104	4,127
מארס	84	1,621	969	1	29	-269	-155	25	44	-61	2,288
אפריל	132	2,493	1,485	-1	-131	-634	-187	46	76	-130	3,149
מאי	32	-675	758	1,305	-1,425	1,382	31	-150	-316	-68	874
יוני	88	1,184	1,223	92	-275	532	-1,253	-21	-43	-56	1,471
יולי	111	2,082	1,679	-257	-27	28	-1,617	1	-19	-80	1,901
אוגוסט	141	2,714	1,643	-312	-300	468	-2,251	-11	30	-88	2,034
ספטמבר	22	1,259	562	16	46	47	-1,242	1	12	-49	674
אוקטובר	-167	-979	-2,224	-6	58	1,566	-864	-13	18	-31	-2,642
נובמבר	-182	-1,802	-2,082	-378	16	878	-2,153	-34	-35	-57	-5,829
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 ההנפקות על הפדיונות בניכוי הדיבידנד במזומן.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית.

לוח ג'-נ' 17 (המשך 3)

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2001 עד 2005
(אחוזים, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											
התקופה	מדד	אג"ח ²	אג"ח 75% מדינה	מט"ח	מניות ³	חז"ל ⁴	שקלי	מעורבות	גמישות	מגן וחשיפה	סך הכול
ד. שיעור התשואה הנומינלי											
2001	11.2	6.0	11.5	12.4	-12.5	-11.0	7.9	1.2	-10.2	8.0	5.2
2002	1.6	-1.5	-1.8	8.1	-28.1	6.6	0.7	-13.2	-24.0	14.1	-0.5
2003	8.5	13.1	12.8	-7.8	60.5	10.5	12.2	29.5	47.4	11.1	13.4
2004	4.5	6.0	4.3	-1.6	17.8	3.3	3.9	10.2	17.1	5.1	5.5
2005	4.6	7.4	5.4	8.5	25.6	9.5	3.4	9.7	19.6	2.3	7.4
2004											
ינואר	0.8	1.1	0.3	2.6	5.2	3.1	-0.2	3.1	6.2	-0.1	1.2
פברואר	-0.9	-0.4	-0.7	0.0	1.5	0.3	-0.1	0.6	1.2	0.2	0.1
מארס	0.6	1.0	0.9	1.1	0.8	0.5	0.8	1.5	1.5	0.7	0.8
אפריל	1.0	0.2	0.0	1.5	2.2	-0.4	-0.2	1.5	1.7	-0.4	0.2
מאי	0.5	0.3	0.8	-1.3	-1.2	-0.8	0.5	-0.2	-1.0	0.7	0.0
יוני	-0.1	1.0	0.3	-1.5	4.5	-0.5	0.6	1.8	3.6	1.2	0.9
יולי	0.4	-0.4	0.1	0.2	-4.7	-1.0	0.1	-1.5	-3.8	-0.7	-0.7
אוגוסט	0.7	0.2	0.6	-0.2	-3.9	0.1	0.5	-0.9	-2.7	0.3	-0.1
ספטמבר	0.7	0.6	0.4	-1.2	0.8	0.0	0.4	0.3	0.6	0.4	0.3
אוקטובר	0.0	0.0	0.3	-0.3	-2.0	1.1	0.3	-0.4	-1.4	0.7	0.2
נובמבר	0.1	1.0	0.3	-2.3	7.2	0.1	0.6	1.6	6.2	0.9	1.2
דצמבר	0.7	1.3	1.0	-0.2	6.6	0.7	0.5	2.4	4.7	1.0	1.3
2005											
ינואר	1.3	1.7	1.3	1.8	5.1	0.1	0.4	2.6	4.1	0.0	1.2
פברואר	0.7	1.1	0.9	-0.2	3.5	0.7	0.4	1.8	3.2	0.4	0.9
מארס	0.2	0.2	0.2	0.0	-0.2	-0.9	0.2	0.0	0.1	0.2	0.0
אפריל	0.4	0.6	0.5	0.4	2.1	-0.5	0.3	1.3	0.9	0.1	0.5
מאי	0.8	0.8	1.0	1.3	1.3	1.3	0.6	0.8	1.4	0.3	0.8
יוני	0.2	-0.3	0.1	4.5	-6.0	3.4	0.0	-2.4	-3.6	0.3	0.0
יולי	0.9	1.3	0.9	-0.9	5.2	0.6	0.4	2.7	3.9	0.2	1.1
אוגוסט	1.5	1.3	1.4	0.6	2.8	0.6	0.3	1.4	2.0	0.2	0.9
ספטמבר	0.5	1.0	0.5	1.1	3.8	1.8	0.3	1.3	3.1	0.1	1.0
אוקטובר	-0.3	0.0	-0.1	1.1	0.4	-0.1	0.1	-0.3	0.1	0.3	0.1
נובמבר	-0.8	-0.4	-0.7	0.4	2.5	2.0	0.0	0.1	1.6	0.0	0.4
דצמבר	-1.0	-0.2	-0.6	-1.7	3.1	0.1	0.4	0.1	1.5	0.2	0.3

(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 חז"ל וני"ע ישראלים בחז"ל.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית.