

לוח ד'-נ'-29

התפתחותן של קרנות הנאמנות¹ מגן וחשיפה, 2003 עד 2007
(אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

הרכב תיק הנכסים (סוף תקופה)																		
אחוזים										יתרות								
שיעור תשואה ³ נומינלי כולל	סך כל המקורות על כל לפעילות ² הנכסים	נכסים פיננסיים עתידיים לא-צמוד						צמוד למט"ח ונקוב במט"ח בארץ				נכסים פיננסיים עתידיים לא-צמוד			צמוד למט"ח ונקוב במט"ח בארץ		נכסי הקרנות (ערך שוק, סוף תקופה)	
		צמוד	בארץ	להמרה	וני"ע	השקעות בחו"ל	צמוד למדד	צמוד	בארץ	להמרה	וני"ע	השקעות בחו"ל	צמוד	בארץ	להמרה	וני"ע		
11.1	331	96	1	0	1	2	0	1,840	13	0	22	32	0	1,908	2003			
5.1	46	95	1	0	1	3	0	1,552	15	0	12	44	0	1,623	2004			
2.3	-815	95	1	0	1	3	0	730	8	0	4	22	0	764	2005			
3.6	-164	56	0	0	7	36	1	28	0	0	4	18	0	50	2006			
4.6	-11	52	0	0	1	47	0	21	0	0	0	18	0	39	2007			
2006																		
0.6	-47	95	1	0	1	3	0	685	9	0	4	23	0	721	ינואר			
0.2	-31	94	1	0	1	4	0	658	5	0	4	24	0	692	פברואר			
0.3	-30	94	1	0	1	4	0	627	7	0	4	25	0	662	מרץ			
0.5	-7	88	3	0	1	8	0	276	9	0	4	26	0	315	אפריל			
0.5	-3	88	2	0	1	9	0	248	6	0	4	26	0	284	מאי			
-1.8	-6	88	2	0	1	9	0	240	4	0	4	26	0	273	יוני			
0.4	-18	87	3	0	1	9	0	222	8	0	4	22	0	256	יולי			
0.4	-9	88	3	0	1	8	0	217	7	0	4	20	0	248	אוגוסט			
0.4	-5	88	3	0	1	8	0	215	7	0	4	19	0	244	ספטמבר			
1.4	-3	88	4	0	1	7	0	212	10	0	4	18	0	244	אוקטובר			
1.7	-2	91	0	0	1	8	0	222	1	0	4	19	0	246	נובמבר			
-1.0	-2	56	0	0	7	36	1	28	0	0	4	18	0	50	דצמבר			
2007																		
-0.3	-2	55	1	0	7	36	1	27	0	0	4	18	0	49	ינואר			
1.0	-3	58	0	0	7	35	0	26	0	0	3	16	0	46	פברואר			
0.6	0	60	0	0	6	34	0	27	0	0	3	16	0	46	מרץ			
-1.2	-2	61	0	0	6	33	0	27	0	0	3	14	0	44	אפריל			
-1.5	-3	58	-1	0	7	36	0	23	0	0	3	14	0	40	מאי			
7.6	-2	60	1	0	8	31	0	22	0	0	3	12	0	37	יוני			
3.6	2	58	1	0	7	34	0	23	1	0	3	13	0	40	יולי			
-5.5	-1	55	0	0	7	38	0	21	0	0	3	14	0	68	אוגוסט			
1.1	1	53	0	0	7	40	0	20	0	0	3	16	0	39	ספטמבר			
0.7	-2	55	0	0	8	37	0	21	0	0	3	14	0	38	אוקטובר			
0.0	1	56	0	0	7	37	0	22	0	0	3	14	0	39	נובמבר			
-1.2	-1	52	0	0	1	47	0	21	0	0	0	18	0	39	דצמבר			

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת כפי שפורסמה בתשקיפי הקרנות. קרן מגן - קרן המשקיעה 10-5 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.