

לוח ג'-נ' 16

התפתחותן של קרנות הנאמנות¹ מגן וחשיפה, 2001 עד 2005 (אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

הרכב תיק הנכסים (סוף תקופה)																
אחוזים								יתרות								
שיעור תשואה ³ נומינלי כולל	סך כל המקורות לפעילות ²	נכסים פיננסיים עתידיים לא-צמוד	מניות וני"ע להמרה	השקעות בחו"ל	צמוד למט"ח ונקוב במט"ח בארץ	צמוד למדד	נכסים פיננסיים עתידיים לא-צמוד	מניות וני"ע להמרה	השקעות בחו"ל	צמוד למט"ח ונקוב במט"ח בארץ	צמוד למדד	נכסי הקרנות (ערך שוק, סוף תקופה)	התקופה			
8.0	232	88	2	2	0	8	0	396	10	7	0	37	0	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	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	
2004																
-0.1	49	93	1	0	1	5	0	1,821	13	0	22	98	0	1,954	ינואר	
0.2	104	94	1	0	1	4	0	1,936	17	0	25	92	0	2,070	פברואר	
0.7	-25	94	1	0	1	4	0	1,916	15	0	26	85	0	2,042	מרס	
-0.4	-39	93	1	0	1	5	0	1,862	14	0	25	91	0	1,993	אפריל	
0.7	-41	93	1	0	1	5	0	1,834	12	0	25	94	0	1,966	מאי	
1.2	171	93	1	0	1	5	0	2,056	14	0	26	118	0	2,214	יוני	
-0.7	13	93	0	0	1	6	0	2,055	10	0	24	132	0	2,221	יולי	
0.3	-117	93	0	0	1	6	0	1,949	6	0	23	122	0	2,100	אוגוסט	
0.4	-93	94	0	0	1	5	0	1,883	8	0	22	102	0	2,015	ספטמבר	
0.7	-10	94	0	0	1	5	0	1,879	10	0	23	108	0	2,019	אוקטובר	
0.9	20	93	1	0	1	5	0	1,912	12	0	23	110	0	2,057	נובמבר	
1.0	16	95	1	0	1	3	0	1,552	15	0	12	44	0	1,623	דצמבר	
2005																
0.0	-22	95	1	0	1	3	0	1,532	9	5	11	43	0	1,601	ינואר	
0.4	-69	95	1	0	1	3	0	1,466	9	3	12	41	0	1,532	פברואר	
0.2	-104	96	1	0	1	2	0	1,381	8	3	12	27	0	1,431	מרס	
0.1	-61	96	1	0	1	2	0	1,322	8	3	11	27	0	1,372	אפריל	
0.3	-130	96	1	0	1	2	0	1,196	10	2	11	27	0	1,245	מאי	
0.3	-68	96	1	0	1	2	0	1,134	7	1	9	29	0	1,179	יוני	
0.2	-56	95	1	0	1	3	0	1,072	6	1	10	28	0	1,118	יולי	
0.2	-80	95	1	0	1	3	0	993	8	2	10	27	0	1,040	אוגוסט	
0.1	-88	96	1	0	1	2	0	860	10	0	5	22	0	897	ספטמבר	
0.3	-49	95	1	0	1	3	0	815	9	0	5	22	0	850	אוקטובר	
0.0	-31	95	1	0	1	3	0	785	7	0	5	23	0	819	נובמבר	
0.2	-57	95	1	0	1	3	0	730	8	0	4	22	0	764	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 מרס 1995 חושב שיעור התשואה בהתבסס על מחיר הפדיון של הקרן.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית.