

לוח ד'-נ'-28

שיעור החשיפה של המשקיעים המוסדיים למט"ח

(סוף תקופה, אחוזים)

קרנות הפנסיה החד		קופות הגמל וקרנות ההשתלמות			סך כל המשקיעים המוסדיים			
שיעור החשיפה למט"ח כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לא כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לנכסים זרים	שיעור החשיפה למט"ח כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לא כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לנכסים זרים	שיעור החשיפה למט"ח כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לא כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	התקופה
6.0	5.8	6.8	10.3	9.8	5.6	8.1	7.9	2005
9.4	9.4	8.9	11.4	11.6	8.6	9.9	10.5	2006
11.5	12.4	12.7	13.1	12.9	11.4	11.7	12.2	2007
8.4	9.0	6.8	9.1	9.4	7.3	7.6	8.4	2008
10.3	14.3	9.6	8.6	11.3	10.9	8.4	11.8	2009
11.1	20.5	12.5	8.2	13.7	13.6	8.8	14.6	2010
11.5	21.1	16.1	10.3	17.0	15.9	10.8	16.7	2011
12.9	21.5	18.8	12.3	18.7	17.6	12.5	18.2	2012
12.4	24.3	20.9	12.5	21.2	20.6	12.4	20.6	2013
13.9	27.8	24.2	13.7	24.0	23.9	14.1	23.5	2014
15.6	27.9	26.8	14.5	24.9	25.0	14.2	23.6	2015
15.3	26.5	26.3	16.0	24.9	25.0	14.9	23.7	2016
17.1	27.0	26.7	16.8	24.4	25.6	16.0	23.6	2017
18.4	29.9	30.2	18.5	27.5	28.6	17.2	26.5	2018
17.5	29.6	30.9	16.6	26.4	29.1	16.4	25.8	2019
17.5	27.6	26.9	16.6	24.3	25.8	16.1	23.9	ינואר
17.1	28.1	27.1	16.5	24.7	26.1	15.9	24.3	פברואר
17.1	28.3	27.2	16.7	25.0	26.3	15.9	24.5	מארס
17.5	29.1	28.1	17.4	25.7	27.3	16.4	25.2	אפריל
17.9	29.3	28.4	17.5	25.7	27.4	16.6	25.4	מאי
18.1	29.6	28.2	18.0	26.2	27.5	16.9	25.7	יוני
18.8	30.3	28.9	18.7	26.9	28.1	17.5	26.3	יולי
18.7	29.9	28.9	18.6	26.8	27.9	17.5	26.1	אוגוסט
18.9	30.0	29.4	18.6	26.6	28.1	17.6	26.1	ספטמבר
18.3	29.6	29.2	18.7	27.0	28.2	17.3	26.1	אוקטובר
19.1	29.8	29.3	19.3	27.5	28.4	17.9	26.4	נובמבר
18.4	29.9	30.2	18.5	27.5	28.6	17.2	26.5	דצמבר
19.0	30.4	29.5	18.7	27.2	28.6	17.5	26.4	2019
19.0	30.3	29.8	18.3	26.8	28.4	17.4	26.1	ינואר
18.7	30.4	30.6	18.5	27.4	28.8	17.3	26.4	פברואר
18.8	30.1	30.2	18.3	27.2	28.7	17.2	26.0	מארס
17.8	29.3	28.6	17.5	26.7	27.3	16.5	25.4	אפריל
18.2	29.4	30.0	17.6	26.6	28.2	16.9	25.6	מאי
17.8	29.3	30.1	17.5	26.5	28.1	16.5	25.3	יוני
17.3	29.0	30.5	17.1	26.5	28.1	16.2	25.3	יולי
17.3	29.0	30.4	17.0	26.5	28.2	16.2	25.3	אוגוסט
17.4	29.5	30.3	17.2	26.5	28.8	16.4	25.7	ספטמבר
17.4	29.6	30.5	16.6	26.4	28.9	16.5	25.8	אוקטובר
17.5	29.6	30.9	16.6	26.4	29.1	16.4	25.8	נובמבר
								דצמבר

המקור: דיווחי קופות הגמל, ההשתלמות והפנסיה לאגף שוק ההון במשרד האוצר ועיבודי החטיבה למידע ולסטטיסטיקה

ולנכסים זרים, 2005 עד 2019

מרווח בין אגח ממ ישראל ואג"ח ממ ארה"ב ל-10 שנים	קרנות הפנסיה הוותיקות						שות
	חברות ביטוח "משתתפות ברווחים"						
	שיעור החשיפה לנכסים זרים	שיעור החשיפה למט"ח כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לא כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה לנכסים זרים	שיעור החשיפה למט"ח כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לא כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה לנכסים זרים
2.1	13.5	16.8	16.9	0.5	0.9	0.9	2.9
1.5	18.7	16.2	19.7	2.6	3.8	3.8	7.5
0.9	19.2	18.0	20.8	4.6	5.6	5.6	10.7
2.3	16.3	12.8	17.4	4.3	4.1	4.1	8.0
1.8	24.3	12.4	24.6	5.3	5.7	5.6	13.5
1.5	27.3	13.0	28.5	5.9	6.4	6.4	19.6
2.2	28.0	15.6	29.3	8.0	8.7	8.8	20.5
2.6	28.2	18.5	29.1	9.3	9.6	10.5	21.2
1.5	31.7	13.5	29.8	11.5	11.7	12.8	24.9
0.4	35.7	15.9	33.2	13.2	13.6	14.7	29.4
-0.1	35.2	16.8	32.1	13.0	11.5	14.4	31.2
0.0	35.0	17.1	31.6	13.6	11.8	15.0	29.6
-0.4	34.6	18.7	30.5	13.8	12.1	14.9	30.5
-0.9	37.2	19.3	33.7	14.5	12.7	16.0	34.1
-0.6	38.3	18.6	32.6	14.2	13.3	15.2	34.0
-0.9	34.6	19.2	31.3	13.8	12.1	14.9	30.6
-0.9	35.2	18.7	31.9	13.6	12.0	14.8	31.3
-1.0	35.4	18.8	32.5	13.8	11.9	14.8	31.5
-1.0	36.7	19.1	33.2	14.2	12.4	15.3	33.0
-0.9	36.8	19.2	33.4	14.2	12.4	15.3	33.0
-0.8	36.5	19.2	33.5	14.6	12.7	15.7	33.3
-0.8	37.2	19.8	33.9	14.8	13.2	16.1	33.8
-0.9	36.8	19.9	33.6	14.7	13.1	15.9	33.4
-0.9	36.6	20.0	33.4	14.8	13.3	16.1	33.5
-0.9	37.2	19.3	33.2	14.6	12.9	15.9	33.7
-0.8	37.2	20.1	33.3	14.9	13.2	16.2	34.1
-0.5	37.2	19.3	33.7	14.5	12.7	16.0	34.1
-0.5	37.7	19.8	33.4	14.5	12.8	15.8	34.3
-0.6	36.9	19.6	33.1	14.3	12.7	15.6	33.8
-0.6	37.4	19.7	33.5	14.3	12.7	15.5	34.1
-0.6	37.3	19.2	32.4	14.4	12.7	15.4	34.2
-0.5	35.0	18.2	31.2	14.1	12.5	15.2	32.5
-0.4	36.3	18.9	31.8	14.4	12.9	15.6	33.2
-0.5	36.4	18.5	31.5	13.9	12.3	14.9	33.1
-0.5	36.4	18.3	31.6	14.0	12.5	15.0	32.9
-0.6	36.4	18.0	31.5	14.1	12.6	15.0	33.1
-0.7	37.8	18.5	32.5	14.4	13.0	15.3	33.9
-0.8	38.2	19.1	32.8	14.3	13.0	15.2	33.9
-0.9	38.3	18.6	32.6	14.2	13.3	15.2	34.0

טיקה של בנק ישראל.

הסברים ללוח ד'-ג'-28: שיעור החשיפה של המשקיעים המוסדיים למט"ח ולנכסים זרים

הנתון	הגדרה והסבר	יחידת המדידה	תדירות הנתון	המקור
שיעור החשיפה למט"ח לא כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	יתרת החשיפה למט"ח (לא כולל נכסים חוץ-מאזניים בש"ח/מט"ח) כאחוז מסך כל נכסי המשקיעים המוסדיים בארץ בחו"ל בשקלים ובמט"ח. יתרת החשיפה למט"ח (לשער חליפין) מוגדרת כסכום הכספי הנתון בסיכון במקרה של שינויים בשערי החליפין של השקל מול מטבעות חוץ.	אחוזים	חודשית	דיווחי האוצר והקופות לבי"י
שיעור החשיפה למט"ח כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	יתרת החשיפה למט"ח (כולל נכסים חוץ-מאזניים בש"ח/מט"ח) כאחוז מסך כל נכסי המשקיעים המוסדיים בארץ בחו"ל בשקלים ובמט"ח. יתרת החשיפה למט"ח (לשער חליפין) מוגדרת כסכום הכספי הנתון בסיכון במקרה של שינויים בשערי החליפין של השקל מול מטבעות חוץ.	אחוזים	חודשית	דיווחי האוצר והקופות לבי"י
שיעור החשיפה לנכסים זרים	יתרת החשיפה לנכסים זרים כאחוז מסך כל נכסי המשקיעים המוסדיים בארץ בחו"ל בשקלים ובמט"ח. יתרת החשיפה לנכסים זרים מוגדרת כסכום הכספי הנתון בסיכון במקרה של ירידה בערכם של נכסים שהנפיקו תושבי חוץ (על פי רוב נכסים המוחזקים בחו"ל).	אחוזים	חודשית	דיווחי האוצר והקופות לבי"י
סך כל המשקיעים המוסדיים	אומדני החשיפות למט"ח ולנכסים זרים, משקפים את החשיפות של העמיתים, ולא של הגופים עצמם, לסיכונים שונים בתיק המנוהל עבורם על ידי הגופים המוסדיים, ובפרט לסיכוני מטבע ולסיכוני החשיפה לנכסים זרים. על כן אומדנים אלה אינם כוללים את תיק הנוסטרו של חברות הביטוח, שכן מנהלות עבור עצמן, ואת תכניות הביטוח המבטיחות תשואה, שבהן הסיכון מוטל על החברות עצמן ולא על העמיתים.	אחוזים	חודשית	דיווחי האוצר והקופות לבי"י
מרווח בין אגח ממ ישראל ואג"ח ממ ארה"ב ל-10 שנים	פער התשואות בין אג"ח ממשלת ישראל ל-10 שנים לאג"ח ממשלת ארה"ב ל-10 שנים.	אחוזים	יומית	נתוני בנק ישראל ובלומברג