

לוח ג'נ-17

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2000 עד 2004
(מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות										
מגן וחשיפה סך הכול	מערובות	גמישות	שקלי	חז"ל ⁴	מניות ³	מט"ח	75% אג"ח מדינה	אג"ח ²	מדד	
א. סך כל הנכסים										
45,832	708	1,923	1,056	26,003	2,115	6,929	2,255	1,944	2,678	221
63,012	451	1,355	648	34,563	4,121	5,537	6,009	3,631	6,107	590
45,840	1,404	725	352	21,253	7,168	2,833	6,116	2,232	3,298	459
83,164	1,908	1,289	463	45,873	11,744	6,668	5,171	4,303	5,302	443
101,101	1,623	2,116	857	49,537	15,693	9,500	2,730	6,695	11,989	361
2003										
46,387	1,570	705	342	21,166	7,662	2,697	6,296	2,199	3,302	448
46,812	1,649	700	338	21,125	7,802	2,714	6,479	2,162	3,387	456
47,607	1,615	737	340	22,191	7,542	2,912	6,291	2,216	3,323	440
49,292	1,553	852	359	23,641	7,262	3,512	6,155	2,216	3,321	421
52,402	1,538	940	375	25,791	7,277	4,117	6,226	2,399	3,331	408
57,208	1,530	1,010	391	27,947	6,944	4,745	6,292	2,683	5,226	440
59,494	1,546	975	382	29,739	7,433	4,384	6,662	2,736	5,197	440
60,762	1,599	957	374	30,998	7,656	4,148	6,778	2,743	5,070	439
64,639	1,672	989	380	34,303	8,087	4,268	6,468	2,915	5,112	445
69,657	1,765	1,093	401	37,073	9,139	4,881	6,478	3,414	4,967	446
76,118	1,902	1,248	448	40,696	9,821	6,061	6,325	3,845	5,316	456
83,164	1,908	1,289	463	45,873	11,744	6,668	5,171	4,303	5,302	443
2004										
89,945	1,954	1,509	495	45,956	15,647	8,131	3,480	5,426	6,868	479
91,813	2,070	1,650	560	44,713	17,186	8,620	3,554	5,616	7,339	505
94,245	2,042	1,749	633	45,291	17,790	9,005	3,690	5,726	8,064	255
95,639	1,993	1,887	762	44,612	18,064	9,588	3,906	5,776	8,746	305
94,997	1,966	1,901	819	43,318	17,780	9,416	3,865	6,239	9,319	374
96,412	2,214	2,051	1,005	43,709	17,196	9,986	3,662	6,434	9,787	368
95,700	2,221	1,993	1,068	44,568	16,307	9,468	3,531	6,205	9,996	343
94,419	2,100	1,789	823	45,384	15,883	8,456	3,373	6,303	9,954	354
95,281	2,015	1,827	809	46,162	15,584	8,454	3,194	6,513	10,345	378
95,818	2,019	1,768	782	46,781	15,608	8,002	3,120	6,721	10,618	399
97,814	2,057	1,979	827	47,771	15,401	8,797	2,851	6,625	11,121	385
101,101	1,623	2,116	857	49,537	15,693	9,500	2,730	6,695	11,989	361

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

(2) קבוצות התמחות אג"ח ואג"ח-להמרה.

(3) התמחות במניות כללית, 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, 2002 עד 2004
(מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות										
מספר הקרנות לסוף התקופה	ההשקעות בארץ	צמודות למדד	מט"ח ונסחרות במט"ח	מניות וני"ע בני המרה	נכסים פיננסיים עתידיים	נכסים לא-צמודים	ההשקעות בחו"ל	מס"ח	מניות ³	חו"ל ⁴
מגן וחסויה סך הכול	מערובות גמישות	שקלי	75% אג"ח מדינה	אג"ח ²	מדד					
ב. הרכב תיק הנכסים										
2002										
584	12	41	7	105	121	148	37	45	63	5
5.6	0.1	2.7	7.5	0.0	0.0	0.1	0.0	53.5	30.0	79.7
12.3	5.0	3.3	14.5	-0.1	10.1	0.8	73.4	4.3	5.4	0.5
8.5	0.0	56.9	47.5	0.0	1.3	88.3	1.2	2.7	16.7	3.1
0.3	1.4	0.7	0.1	0.0	0.1	0.3	1.4	0.2	0.1	0.0
59.0	93.5	27.2	25.7	100.1	2.9	7.1	22.0	38.6	45.2	16.7
14.3	0.0	9.2	4.7	0.0	85.6	3.4	2.0	0.7	2.6	0.0
2003										
648	11	41	6	141	134	155	39	52	64	5
6.7	-0.1	3.3	17.8	0.0	0.0	0.4	0.0	54.5	49.4	85.9
5.7	1.7	2.8	14.6	0.1	10.6	0.3	59.2	1.6	3.2	0.3
9.9	0.0	64.3	43.5	0.3	2.0	86.8	1.7	3.3	15.3	3.8
0.2	0.7	0.9	0.0	0.0	0.0	1.3	2.3	0.0	-0.8	0.1
64.9	96.5	17.3	19.0	99.6	8.1	8.4	23.5	40.2	31.3	9.7
12.6	1.2	11.4	5.1	0.0	79.3	2.8	13.3	0.4	1.6	0.2
2004										
793	11	38	8	166	200	186	31	57	94	2
8.8	0.0	2.2	18.3	0.1	0.0	-0.1	0.3	64.6	32.9	93.6
4.7	2.7	2.1	12.9	0.1	12.3	0.6	64.1	1.5	5.2	0.0
13.0	0.0	66.3	39.8	0.6	1.7	86.8	3.6	3.5	18.9	2.2
0.1	0.9	0.8	0.1	0.0	0.1	0.8	3.8	0.0	-0.7	0.0
60.4	95.6	20.4	27.4	99.2	8.6	8.9	18.3	29.9	42.0	4.2
13.0	0.8	8.2	1.5	0.0	77.3	3.0	9.9	0.5	1.7	0.0

(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 2)

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2000 עד 2004
(מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצות ההתמחות										
התקופה	מדד	אג"ח ²	אג"ח 75% מדינה	מט"ח	מניות ³	חור"ל ⁴	שקלי	מעורבות גמישות	מגן וחספיפה סך הכול	
ג. סך המקורות לפעילות ⁵										
2000	-69	-254	-252	-594	1,352	1,076	9,982	-6	37	-270
2001	341	3,168	1,593	3,275	-265	2,001	5,568	-187	-328	232
2002	-115	-2,538	-1,019	-321	-1,146	2,713	-12,980	-191	-281	967
2003	-49	1,793	1,545	524	1,973	2,922	21,497	24	183	331
2004	164	5,841	2,155	-337	1,618	1,510	1,675	512	711	46
2003										
ינואר	-16	23	-44	111	-63	252	-148	-9	-9	144
פברואר	4	-32	10	135	-14	158	-203	-8	-9	68
מרס	-15	-105	27	25	52	-92	641	-6	22	-38
אפריל	-21	-67	-39	54	210	-171	1,097	-1	39	-68
מאי	-19	-47	146	246	228	-171	1,743	0	12	-43
יוני	22	1,824	231	188	447	-162	1,856	5	24	-8
יולי	6	15	84	222	-79	331	1,759	-3	7	10
אוגוסט	-1	-129	2	83	-143	203	1,072	-5	-11	53
ספטמבר	1	-4	118	-272	-42	259	2,944	-2	6	42
אוקטובר	-1	20	227	-91	204	778	2,501	7	26	74
נובמבר	3	261	386	-84	814	699	3,339	32	65	123
דצמבר	-12	33	398	-93	358	839	4,896	15	10	-25
2004										
ינואר	33	1,322	1,196	215	1,156	1,538	224	73	164	49
פברואר	30	536	250	74	390	1,454	-1,176	63	121	104
מרס	7	470	-6	98	321	482	229	65	77	-25
אפריל	47	826	51	158	397	345	-723	122	114	-39
מאי	68	503	408	11	-48	-160	-1,525	62	88	-41
יוני	-5	413	181	-150	143	-438	175	107	99	171
יולי	-27	273	-237	-137	-50	-716	809	74	25	13
אוגוסט	8	-208	52	-150	-632	-448	619	-72	-140	-117
ספטמבר	22	354	158	-124	-72	-265	627	-5	29	-93
אוקטובר	21	274	206	-62	-281	-142	449	-24	-35	-10
נובמבר	-14	392	-115	-187	201	-166	720	36	95	20
דצמבר	-27	687	11	-83	92	27	1,245	11	74	16

(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 חור"ל וני"ע ישראלים בחור"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, 2000 עד 2004
(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 וחיפה סך הכול	
ד. שיעור התשואה הנומינלי										
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
2004	4.5	6.0	4.3	-1.6	17.8	3.3	3.9	10.2	5.1	5.5
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
מארס	0.1	1.3	1.6	-3.3	5.2	-2.1	2.0	2.6	3.9	0.8
אפריל	0.4	2.1	1.8	-3.0	13.2	-1.1	2.1	5.9	10.0	1.9
מאי	1.5	1.7	2.0	-2.6	10.7	2.6	1.1	4.7	8.2	1.9
יוני	2.7	1.4	2.4	-1.9	4.5	-2.0	1.3	3.1	4.5	0.9
יולי	-1.2	-0.8	-0.6	2.4	-5.9	2.5	0.1	-1.8	-4.0	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	2.4	1.4
אוקטובר	0.6	1.6	0.9	1.5	9.5	3.2	0.8	4.4	7.8	2.0
נובמבר	1.4	1.6	1.2	-1.1	7.8	0.1	0.7	3.5	6.4	1.3
דצמבר	-0.3	0.8	0.0	-1.7	4.0	1.2	0.7	1.6	2.7	0.9
2004										
ינואר	0.8	1.1	0.3	2.6	5.2	3.1	-0.2	3.1	-0.1	1.2
פברואר	-0.9	-0.4	-0.7	0.0	1.5	0.3	-0.1	0.6	1.2	0.1
מארס	0.6	1.0	0.9	1.1	0.8	0.5	0.8	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	0.2
מאי	0.5	0.3	0.8	-1.3	-1.2	-0.8	0.5	-0.2	-1.0	0.0
יוני	-0.1	1.0	0.3	-1.5	4.5	-0.5	0.6	1.8	3.6	0.9
יולי	0.4	-0.4	0.1	0.2	-4.7	-1.0	0.1	-1.5	-3.8	-0.7
אוגוסט	0.7	0.2	0.6	-0.2	-3.9	0.1	0.5	-0.9	-2.7	-0.1
ספטמבר	0.7	0.6	0.4	-1.2	0.8	0.0	0.4	0.3	0.6	0.3
אוקטובר	0.0	0.0	0.3	-0.3	-2.0	1.1	0.3	-0.4	-1.4	0.2
נובמבר	0.1	1.0	0.3	-2.3	7.2	0.1	0.6	1.6	6.2	1.2
דצמבר	0.7	1.3	1.0	-0.2	6.6	0.7	0.5	2.4	4.7	1.3

(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 בחו"ל.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית.