

לוח ד'-נ'-28

שיעור החשיפה של המשקיעים המוסדיים למט"ח ולנכסים זרים, 2004 עד 2018

(סוף תקופה, אחוזים)

מרווח בין אגח ממ ישראל וממ ואג"ח ממ ארה"ב ל-10 שנים	חברות ביטוח "משתתפות ברווחים"			קרנות הפנסיה הוותיקות			קרנות הפנסיה החדשות			קופות הגמל וקרנות ההשתלמות			סך כל המשקיעים המוסדיים			התקופה
	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	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	שיעור החשיפה למט"ח כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	שיעור החשיפה למט"ח לא כולל נגזרי ש"ח/מט"ח	
3.3	8.3	11.9	11.7	0.0	0.2	0.2	0.4	2.2	2.2	2.9	6.4	6.1	2.7	5.1	4.9	2004
2.1	13.5	16.8	16.9	0.5	0.9	0.9	2.9	6.0	5.8	6.8	10.3	9.8	5.6	8.1	7.9	2005
1.5	18.7	16.2	19.7	2.6	3.8	3.8	7.5	9.4	9.4	8.9	11.4	11.6	8.6	9.9	10.5	2006
0.9	19.2	18.0	20.8	4.6	5.6	5.6	10.7	11.5	12.4	12.7	13.1	12.9	11.4	11.7	12.2	2007
2.3	16.3	12.8	17.4	4.3	4.1	4.1	8.0	8.4	9.0	6.8	9.1	9.4	7.3	7.6	8.4	2008
1.8	24.3	12.4	24.6	5.3	5.7	5.6	13.5	10.3	14.3	9.6	8.6	11.3	10.9	8.4	11.8	2009
1.5	27.3	13.0	28.5	5.9	6.4	6.4	19.6	11.1	20.5	12.5	8.2	13.7	13.6	8.8	14.6	2010
2.2	28.0	15.6	29.3	8.0	8.7	8.8	20.5	11.5	21.1	16.1	10.3	17.0	15.9	10.8	16.7	2011
2.6	28.2	18.5	29.1	9.3	9.6	10.5	21.2	12.9	21.5	18.8	12.3	18.7	17.6	12.5	18.2	2012
1.5	31.7	13.5	29.8	11.5	11.7	12.8	24.9	12.4	24.3	20.9	12.5	21.2	20.6	12.4	20.6	2013
0.4	35.7	15.9	33.2	13.2	13.6	14.7	29.4	13.9	27.8	24.2	13.7	24.0	23.9	14.1	23.5	2014
-0.1	35.2	16.8	32.1	13.0	11.5	14.4	31.2	15.6	27.9	26.8	14.5	24.9	25.0	14.2	23.6	2015
0.0	35.0	17.1	31.6	13.6	11.8	15.0	29.6	15.3	26.5	26.3	16.0	24.9	25.0	14.9	23.7	2016
-0.4	34.6	18.7	30.5	13.8	12.1	14.9	30.5	17.1	27.0	26.7	16.8	24.4	25.6	16.0	23.6	2017
-0.9	37.2	19.3	33.7	14.5	12.7	16.0	34.1	18.4	29.9	30.2	18.5	27.5	28.6	17.2	26.5	2018
																2017
-0.3	34.8	17.7	31.0	13.6	11.8	15.0	30.1	15.8	26.5	26.1	16.6	24.9	25.1	15.3	23.6	ינואר
-0.2	34.7	18.3	30.8	13.7	11.9	15.1	29.6	15.7	26.3	25.7	16.4	24.5	24.9	15.3	23.5	פברואר
-0.3	35.1	18.4	31.4	13.4	11.8	15.0	29.7	15.8	26.4	25.8	16.1	24.5	25.0	15.3	23.6	מארס
-0.2	34.9	18.3	30.9	13.5	11.8	14.8	29.9	15.8	26.3	26.0	16.0	24.5	25.1	15.2	23.4	אפריל
-0.2	34.4	18.1	30.7	13.5	11.7	14.9	29.7	15.6	26.3	25.9	15.9	24.3	25.0	15.1	23.4	מאי
-0.2	33.6	18.2	30.5	13.3	11.6	14.8	29.4	16.0	26.3	25.7	15.8	24.1	24.7	15.1	23.3	יוני
-0.3	34.5	18.2	30.8	13.7	11.7	14.9	29.9	16.0	26.7	26.2	16.2	24.5	25.2	15.3	23.6	יולי
-0.4	34.9	18.0	30.8	13.7	11.7	14.8	30.2	16.2	26.9	26.3	16.1	24.5	25.4	15.2	23.6	אוגוסט
-0.5	35.1	18.4	30.9	13.7	11.8	14.8	30.3	16.4	26.8	26.3	16.1	24.3	25.5	15.5	23.6	ספטמבר
-0.6	35.0	18.4	30.6	13.8	12.0	14.9	30.4	16.6	26.7	26.5	16.3	24.2	25.6	15.6	23.5	אוקטובר
-0.6	35.1	18.4	30.6	13.9	12.1	15.0	30.4	16.7	26.7	26.6	16.4	24.4	25.7	15.7	23.6	נובמבר
-0.6	34.6	18.7	30.5	13.8	12.1	14.9	30.5	17.1	27.0	26.7	16.8	24.4	25.6	16.0	23.6	דצמבר
																2018
-0.9	34.6	19.2	31.3	13.8	12.1	14.9	30.6	17.5	27.6	26.9	16.6	24.3	25.8	16.1	23.9	ינואר
-0.9	35.2	18.7	31.9	13.6	12.0	14.8	31.3	17.1	28.1	27.1	16.5	24.7	26.1	15.9	24.3	פברואר
-1.0	35.4	18.8	32.5	13.8	11.9	14.8	31.5	17.1	28.3	27.2	16.7	25.0	26.3	15.9	24.5	מארס
-1.0	36.7	19.1	33.2	14.2	12.4	15.3	33.0	17.5	29.1	28.1	17.4	25.7	27.3	16.4	25.2	אפריל
-0.9	36.8	19.2	33.4	14.2	12.4	15.3	33.0	17.9	29.3	28.4	17.5	25.7	27.4	16.6	25.4	מאי
-0.8	36.5	19.2	33.5	14.6	12.7	15.7	33.3	18.1	29.6	28.2	18.0	26.2	27.5	16.9	25.7	יוני
-0.8	37.2	19.8	33.9	14.8	13.2	16.1	33.8	18.8	30.3	28.9	18.7	26.9	28.1	17.5	26.3	יולי
-0.9	36.8	19.9	33.6	14.7	13.1	15.9	33.4	18.7	29.9	28.9	18.6	26.8	27.9	17.5	26.1	אוגוסט
-0.9	36.6	20.0	33.4	14.8	13.3	16.1	33.5	18.9	30.0	29.4	18.6	26.6	28.1	17.6	26.1	ספטמבר
-0.9	37.2	19.3	33.2	14.6	12.9	15.9	33.7	18.3	29.6	29.2	18.7	27.0	28.2	17.3	26.1	אוקטובר
-0.8	37.2	20.1	33.3	14.9	13.2	16.2	34.1	19.1	29.8	29.3	19.3	27.5	28.4	17.9	26.4	נובמבר
-0.5	37.2	19.3	33.7	14.5	12.7	16.0	34.1	18.4	29.9	30.2	18.5	27.5	28.6	17.2	26.5	דצמבר

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