



אלו שינויים חלו בתיק הנכסים של כולנו על רקע משבר הקורונה?

מרדכי אילן

מבט על הסטטיסטיקה הפיננסית

mordechai.ilan@boi.org.il

מרץ 2021



התפתחויות
בתיק הנכסים
במהלך 2020



מתודולוגיה
רקע קצר
על תיק הנכסים

מתודולוגיה - תכולת התיק



סקטורים

גופים מוסדיים
ציבור במישרין
- משקי בית
- סקטור עסקי
- קרנות נאמנות



נכסים

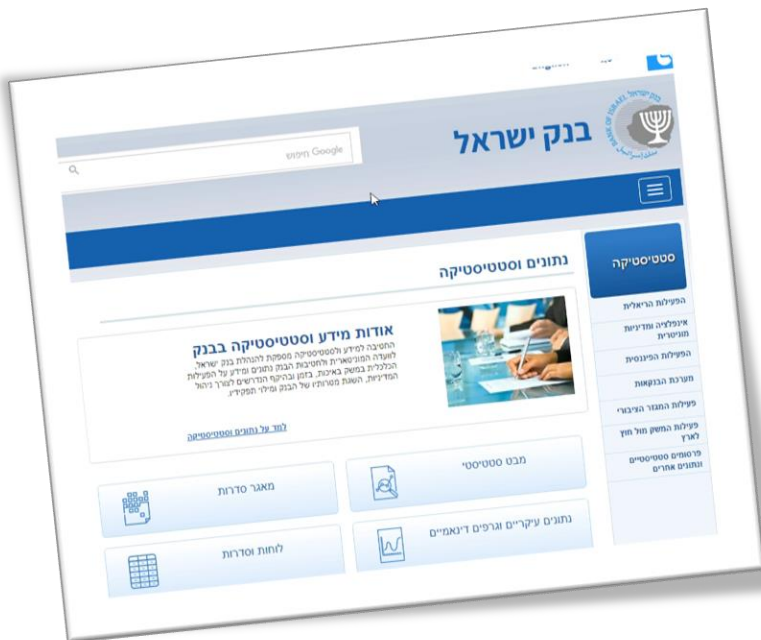
מזומן
פיקדונות
אג"ח ממשלתיות
אג"ח חברות
מניות בארץ
השקעות בחו"ל

מתודולוגיה - עיבוד הנתונים

תוצרים

עיבודים

מקורות



Time	first pressure to ISO27 73000	first pressure to ISO27 73000	first pressure to ISO27 73000	first pressure to ISO27 73000	first pressure to ISO27 73000	first pressure to ISO27 73000	first pressure to ISO27 73000
Time	Value 1	Value 2	Value 3	Value 4	Value 5	Value 6	Value 7
Seconds	hour	hour	hour	hour	hour	hour	hour
282.5	31.3076	31.3076	31.3087	31.3087	31.3088	31.3088	31.3089
283	31.3052	31.3161	31.4841	31.4841	31.3085	31.3085	31.3085
283.5	31.3086	31.3118	31.497	31.497	31.3087	31.3087	31.3087
284	31.3089	31.3184	31.4964	31.4964	31.3083	31.3083	31.3083
284.5	31.3103	31.3102	31.4870	31.4870	31.3074	31.3074	31.3074
285	31.3175	31.4006	31.4880	31.4880	31.3050	31.3050	31.3050
285.5	31.4020	31.4064	31.4821	31.4821	31.3048	31.3048	31.3048
285.9	31.4023	31.4023	31.4840	31.4840	31.3117	31.3117	31.3117
286	31.4008	31.4207	31.5096	31.5096	31.3063	31.3063	31.3063
286.5	31.4000	31.4000	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
286.9	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
287	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
287.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
287.9	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
288	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
288.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
289	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
289.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
290	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
290.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
291	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
291.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
292	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
292.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
293	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
293.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
294	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
294.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
295	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
295.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
296	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
296.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
297	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
297.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
298	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
298.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
299	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
299.5	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049
300	31.4009	31.4009	31.5096	31.5096	31.3049	31.3049	31.3049

מערכת הבנקאות

הבורסה לני"ע

פעילות מול חו"ל

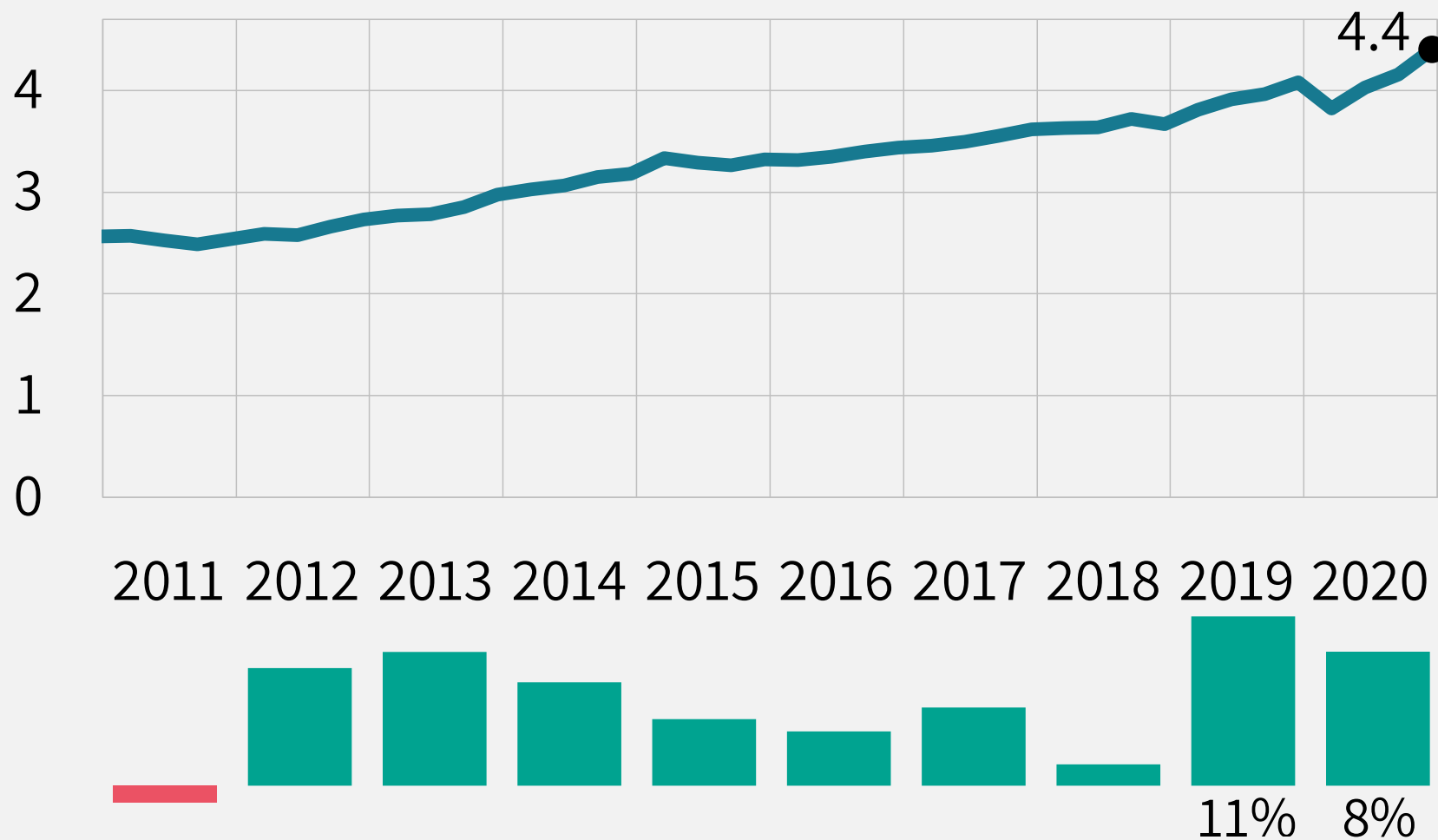
הגופים המוסדיים

משרד האוצר



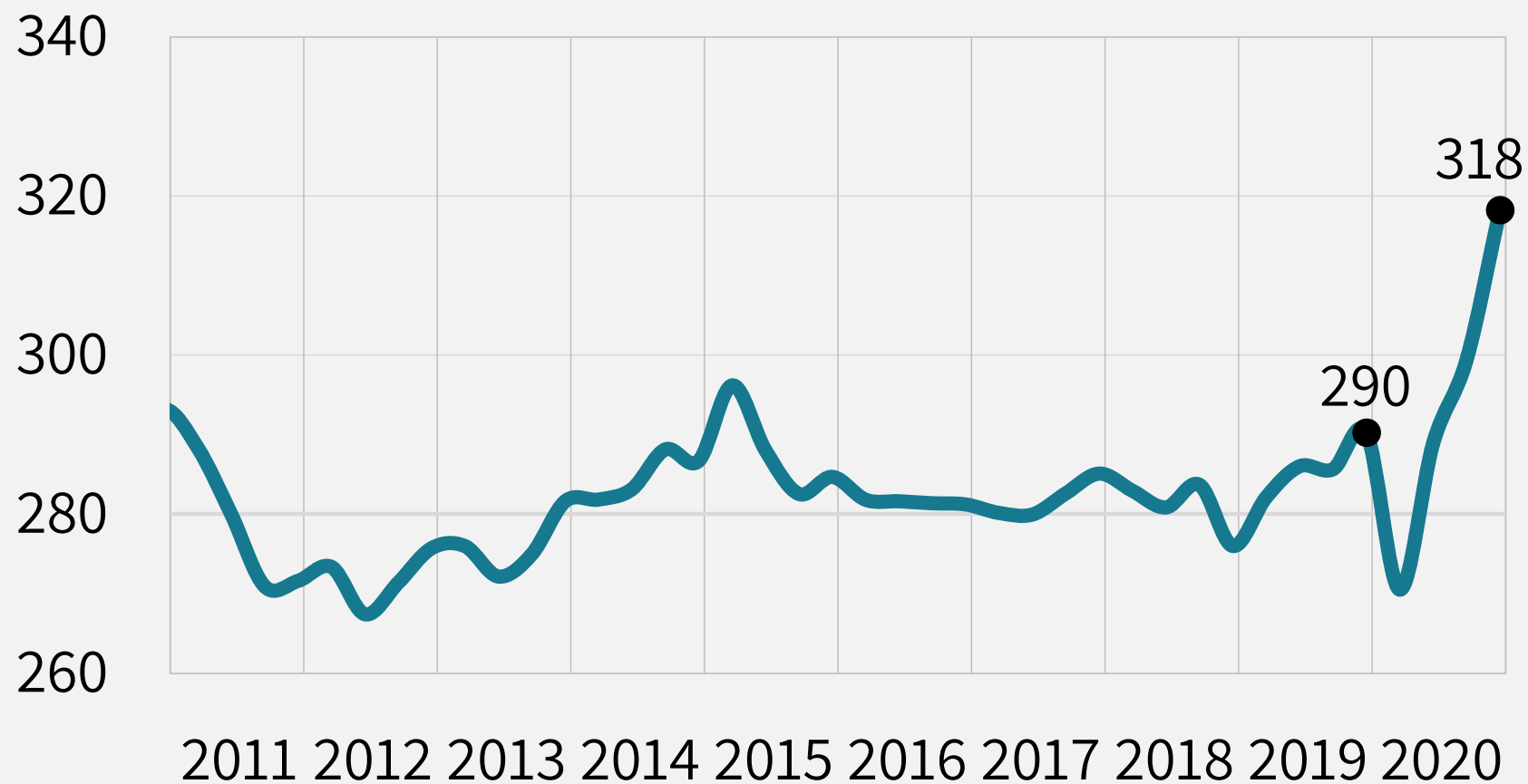
התפתחויות עיקריות

ב-2020 תיק הנכסים עלה בשיעור גבוה מהממוצע ב-10 השנים האחרונות



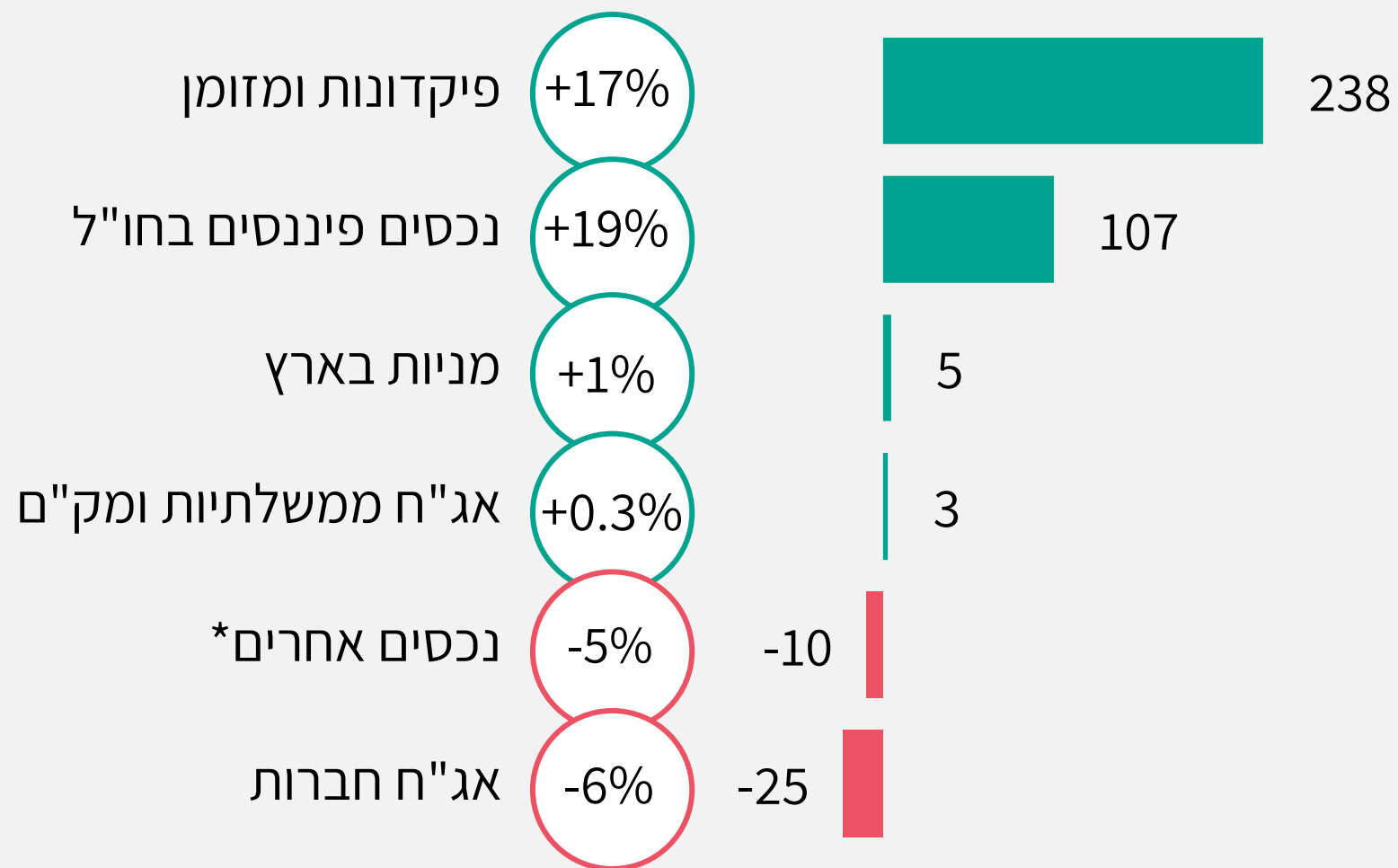
יתרת תיק
הנכסים
טריליוני ש"ח (קו)
ושיעור שינוי שנתי
(ברים)

ביחס לתוצר, נרשמה עלייה משמעותית - תרמה לכך גם ההתכווצות בתוצר



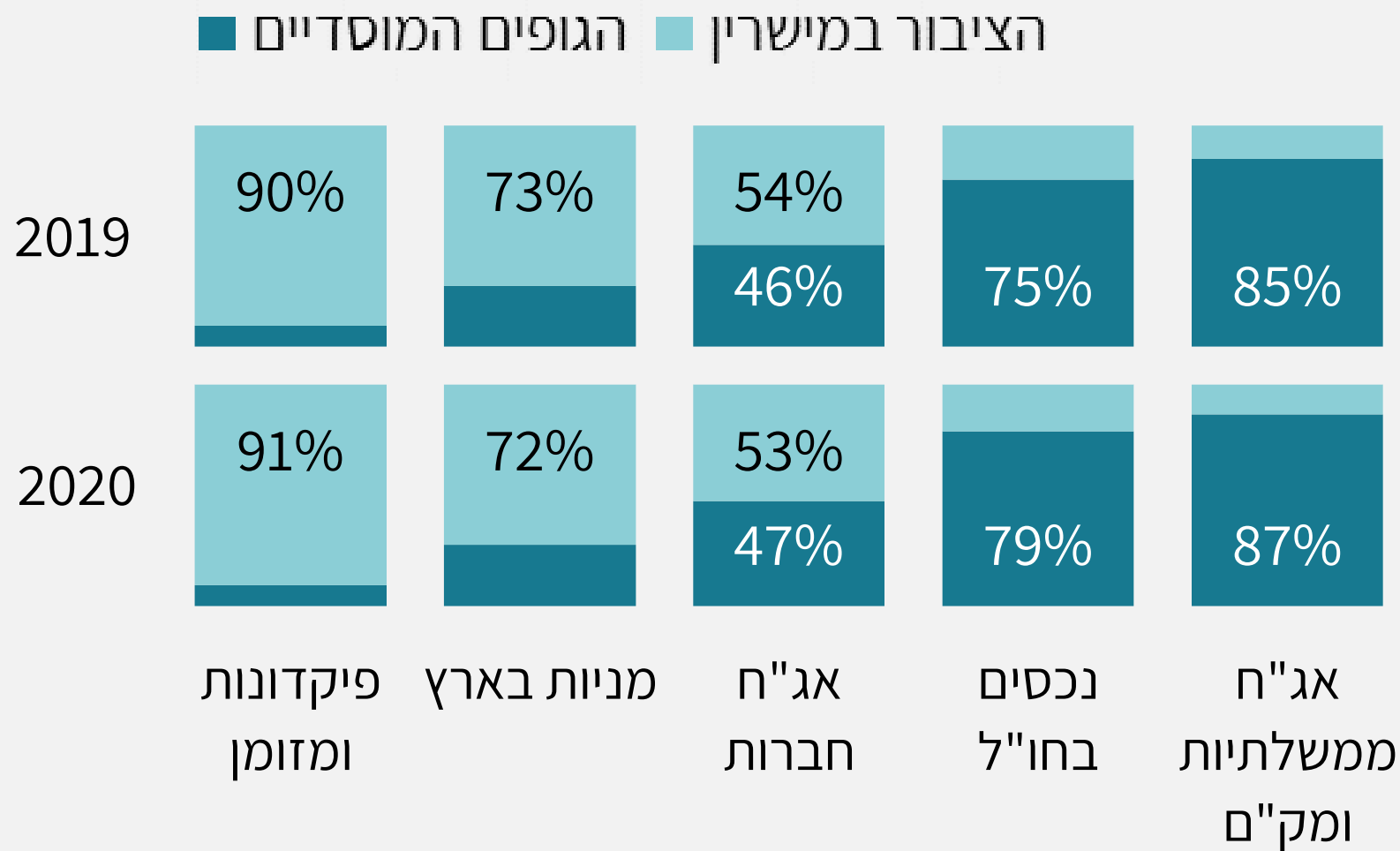
יתרת תיק
הנכסים
כאחוז מהתוצר

עלייה חדה ביתרות הפיקדונות ובנכסים בחו"ל



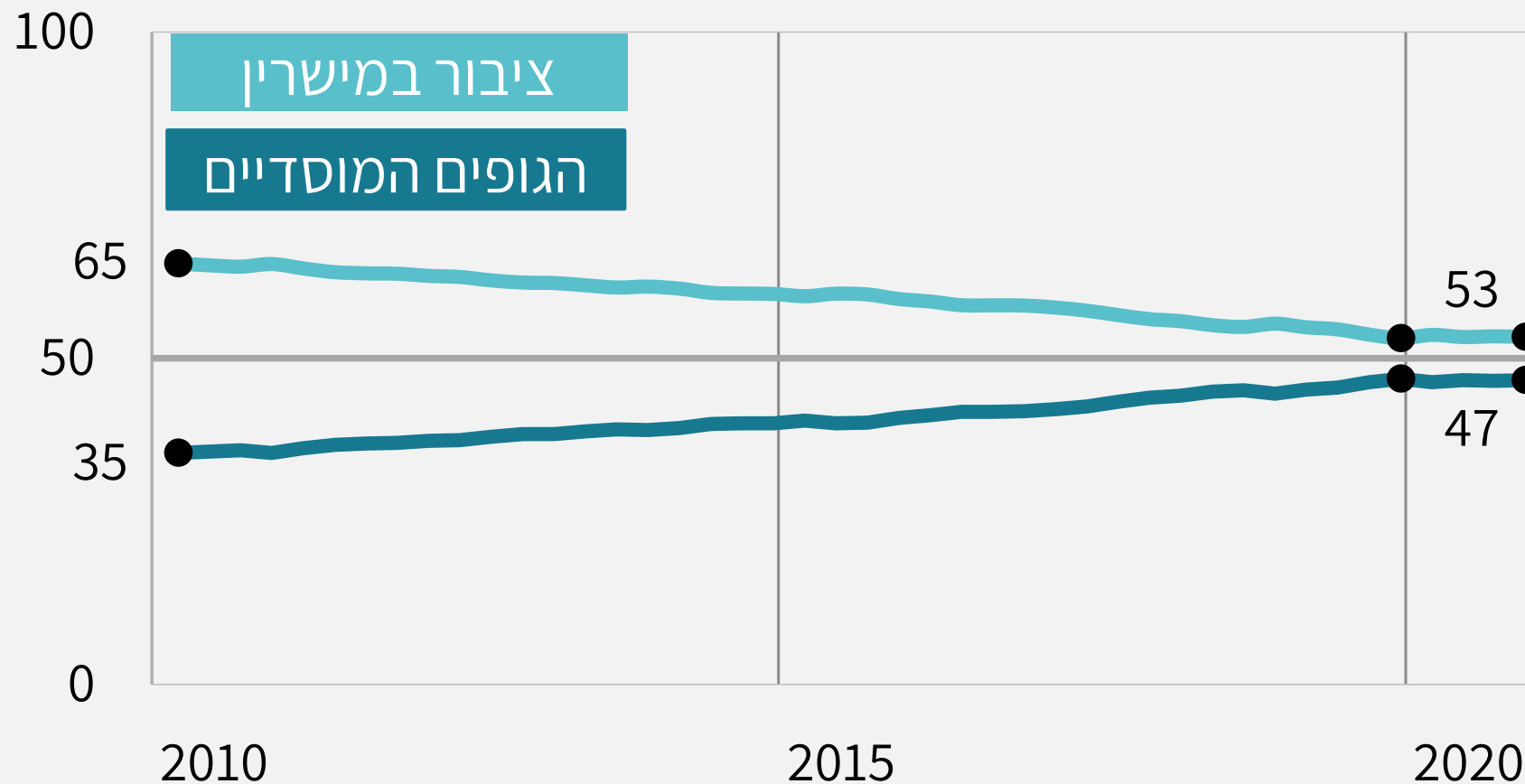
השינוי ביתרת
הנכסים בתיק
ב-2020
במיליארדי ש"ח
(ברים)
ושינוי באחוזים
(בועות)

משקל המוסדיים בנכסים בחו"ל גדל, משקל הציבור בנכסי ניירות הערך ירד



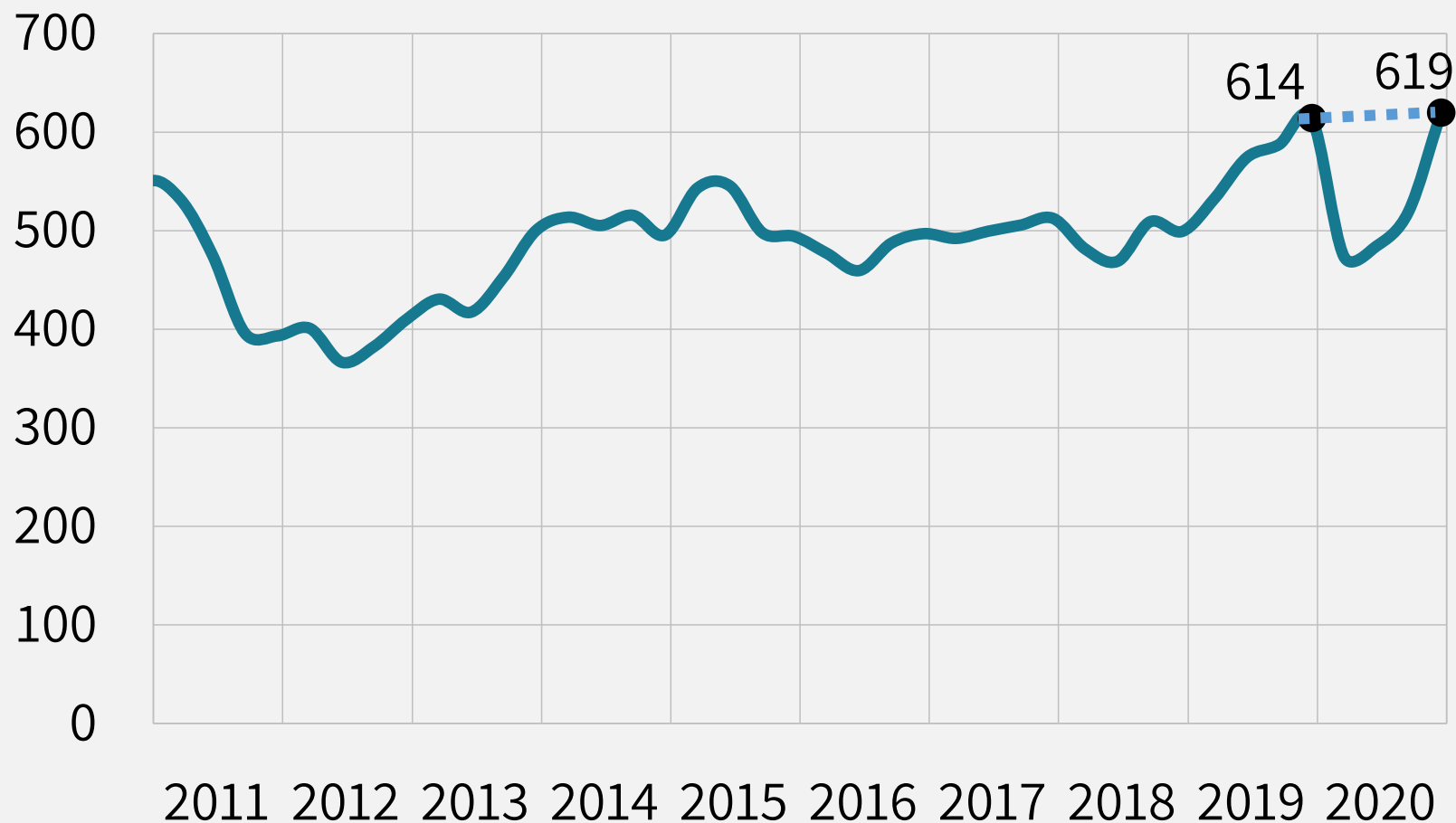
התפלגות
ההחזקות
בתיק
לפי נכסי הציבור
במישרין לעומת
הגופים המוסדיים

בניגוד למגמה ארוכת הטווח, השנה משקל נכסי המוסדיים מסך התיק לא עלה



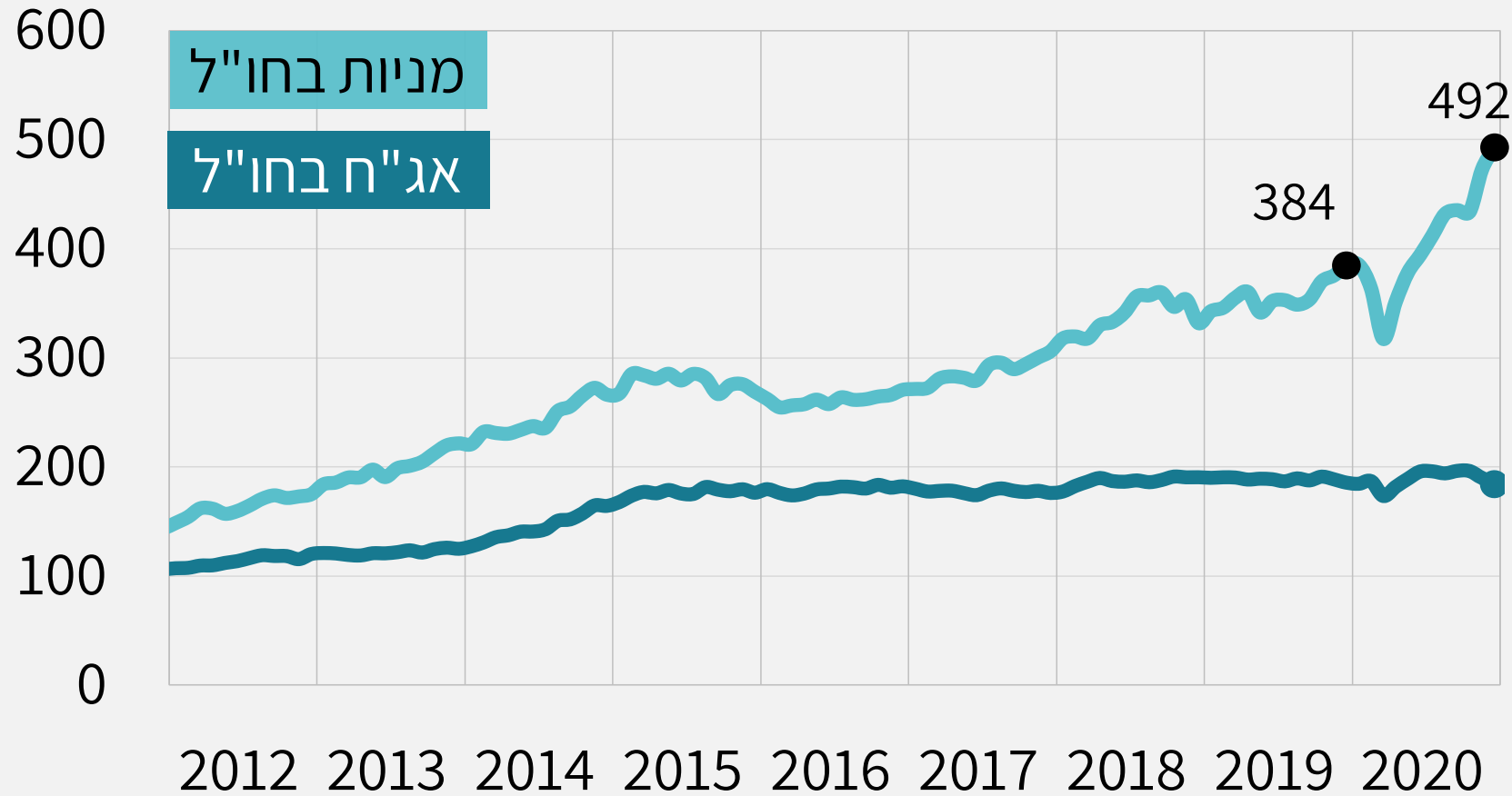
התפלגות
ההחזקות
בתיק
לפי מנהל,
אחוז מסך התיק

יתרת המניות בארץ עלתה בחישוב שנתי, למרות המשבר בשווקים



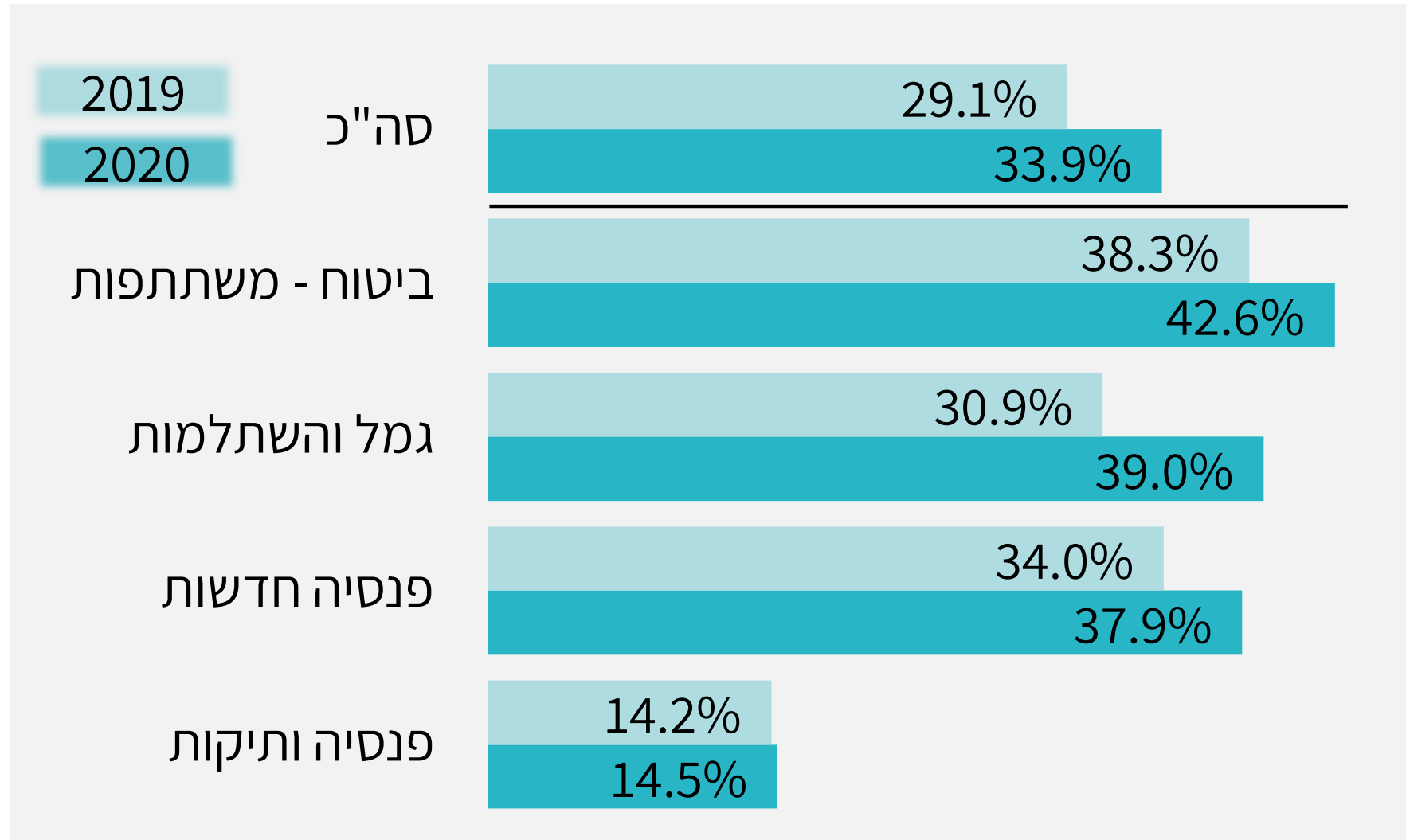
יתרת המניות
בארץ
מיליארדי ש"ח

יתרת ההחזקות במניות בחו"ל עלתה משמעותית



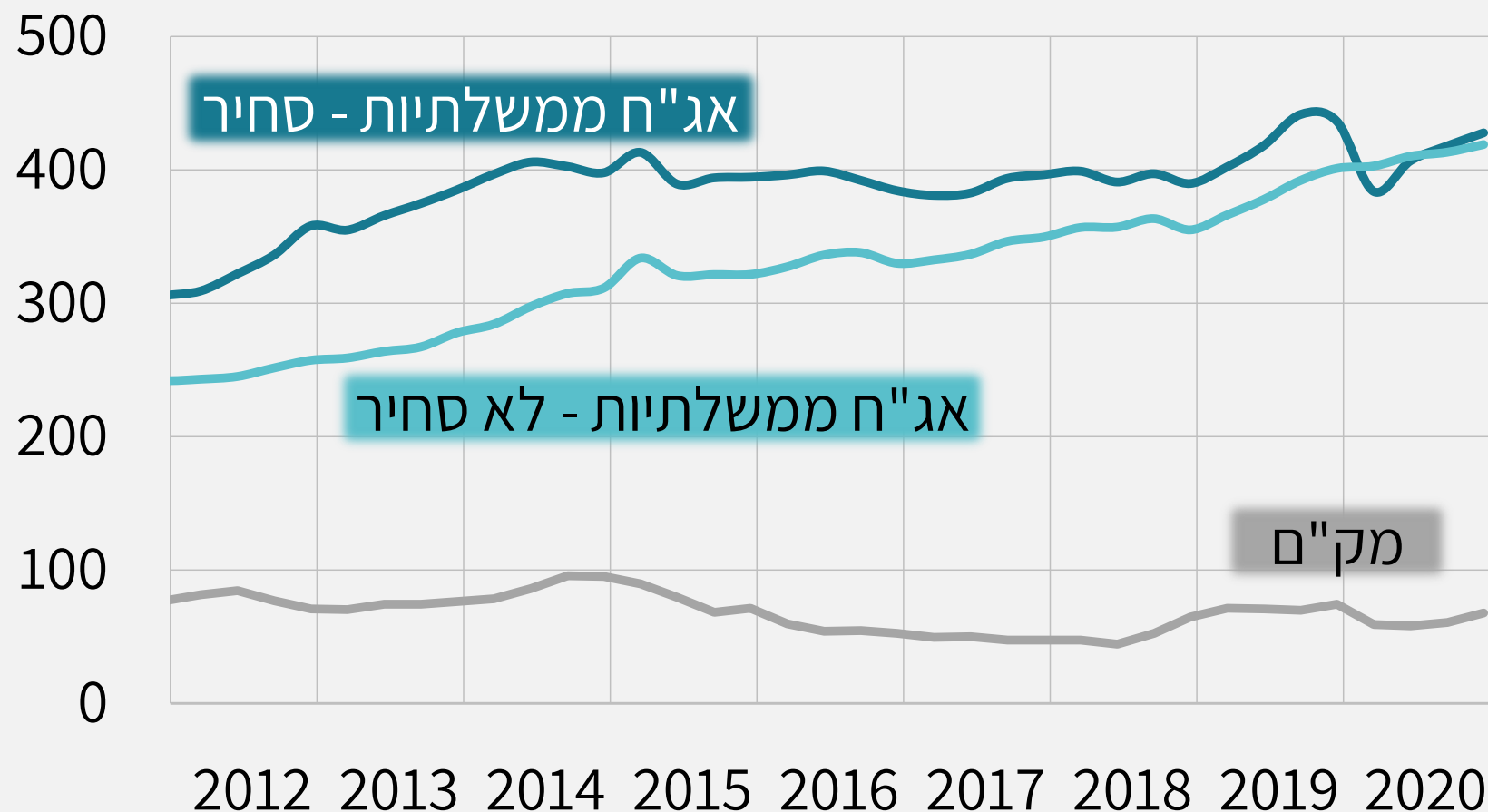
יתרות מניות
ואג"ח בחו"ל
מיליארדי ש"ח

חשיפת המוסדיים לנכסים זרים רשמה עלייה חדה במרבית הגופים



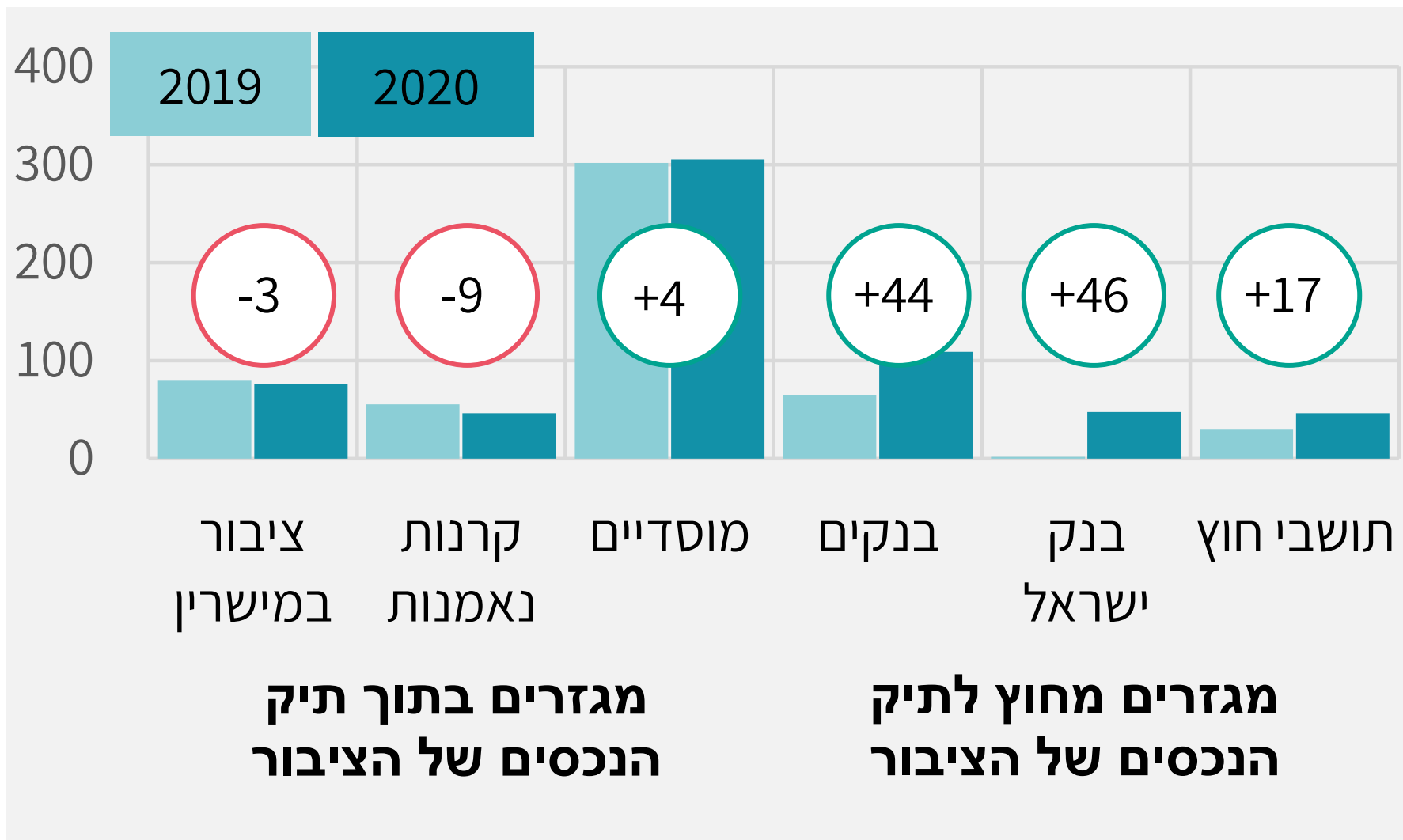
חשיפה
לנכסים זרים
של הגופים
המוסדיים
אחוז מסך הנכסים

יתרת האג"ח הממשלתיות רשמה גידול אפסי במהלך 2020



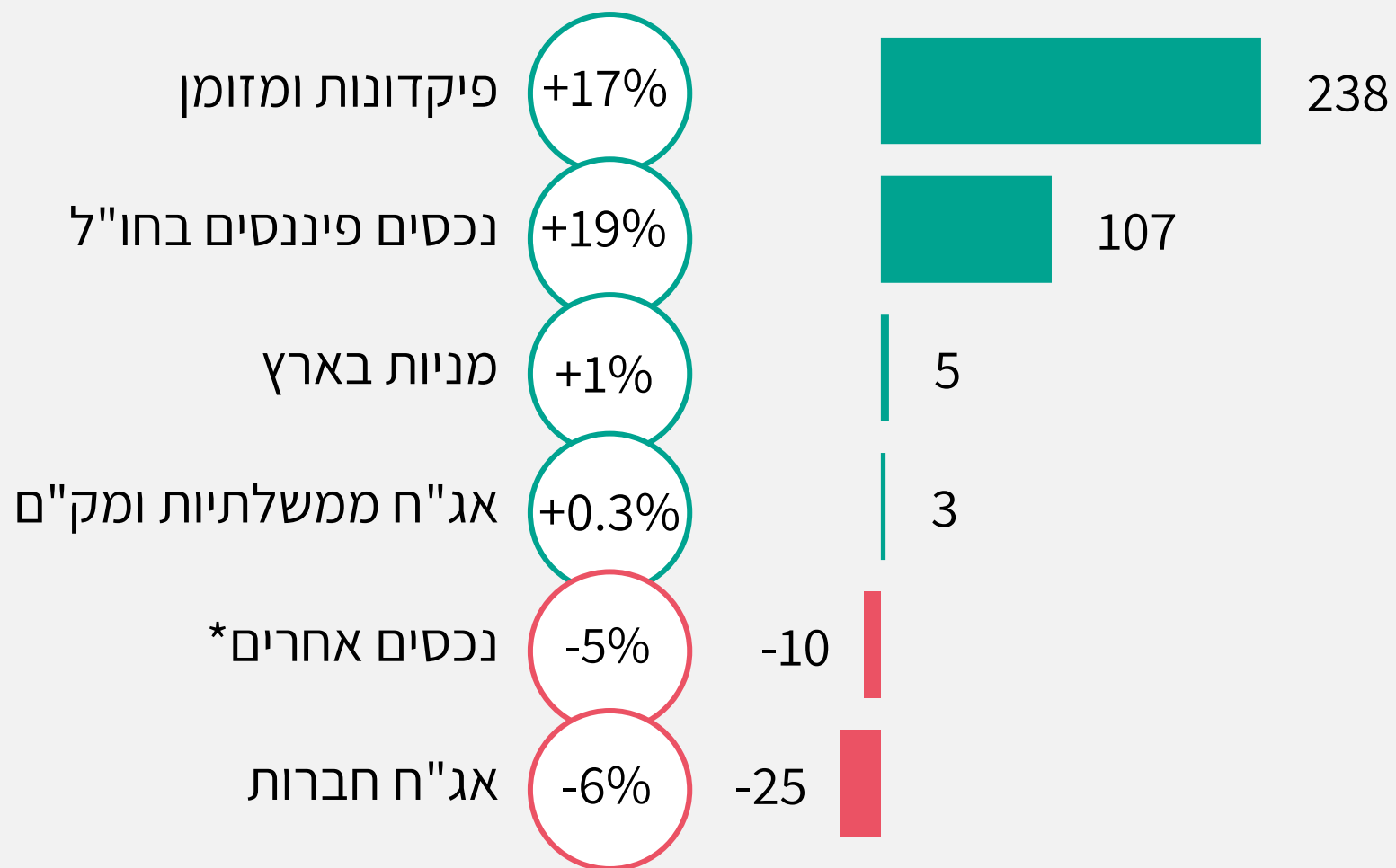
אג"ח
ממשלתיות
מיליארדי ש"ח

ב-2020 עיקר רכישות האג"ח הממשלתיות היו על ידי המגזרים מחוץ לתיק



רכישות אג"ח
ממשלתיות
ע"י סקטורים
מיליארדי ש"ח

העלייה ביתרות הפיקדונות ובנכסים בחו"ל הביאו לעלייה משמעותית בתיק ב- 2020



השינוי ביתרת
הנכסים בתיק
ב-2020
במיליארדי ש"ח
(ברים)
ושינוי באחוזים
(בועות)



תודה רבה!

מרדכי אילן

מבט על הסטטיסטיקה הפיננסית

mordechai.ilan@boi.org.il

מרץ 2021