

לוח ג'נ'16

התפתחותן של קרנות הנאמנות¹ מגן וחשיפה, 2000 עד 2004 (אחוזים, מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

הרכב תיק הנכסים (סוף תקופה)															
אחוזים								יתרות							
שיעור תשואה ³ נומינלי כולל על כל הנכסים	סך כל המקורות לפעילות ²	נכסים פוננסיים לא-צמוד	נכסים עתידיים בארץ	מניות וני"ע להמרה	השקעות בחו"ל	צמוד למט"ח ונקוב במט"ח בארץ	צמוד למדד	נכסים פוננסיים לא-צמוד	נכסים עתידיים בארץ	מניות וני"ע להמרה	השקעות בחו"ל	צמוד למט"ח ונקוב במט"ח בארץ	צמוד למדד	נכסי הקרנות (ערך שוק, סוף תקופה)	התקופה
5.6	-270	99	1	0	0	0	0	701	5	2	0	0	0	708	2000
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
2003															
1.6	144	86	1	0	1	12	0	1,342	17	0	21	190	0	1,570	ינואר
0.6	68	93	0	0	2	5	0	1,532	8	0	27	82	0	1,649	פברואר
0.5	-38	94	0	0	2	4	0	1,515	7	0	25	68	0	1,615	מארס
0.7	-68	88	0	0	1	11	0	1,360	1	0	23	169	0	1,553	אפריל
1.0	-43	90	0	0	1	9	0	1,371	3	0	21	143	0	1,538	מאי
0.2	-8	96	0	0	1	3	0	1,469	-4	0	16	49	0	1,530	יוני
0.3	10	95	0	0	1	4	0	1,473	4	0	15	54	0	1,546	יולי
0.0	53	92	0	0	1	7	0	1,468	2	0	15	115	0	1,599	אוגוסט
2.1	42	95	1	0	1	3	0	1,604	9	0	12	47	0	1,672	ספטמבר
1.0	74	97	0	0	1	2	0	1,697	7	1	20	40	0	1,765	אוקטובר
0.8	123	94	0	0	1	5	0	1,783	9	0	20	89	0	1,902	נובמבר
1.7	-25	96	1	0	1	2	0	1,840	13	0	22	32	0	1,908	דצמבר
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	מארס
-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

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת כפי שפורסמה בתשקיפי הקרנות. קרן מגן - קרן המשקיעה 5-10 אחוזים מנכסיה באופציות מעו"ף ואת היתר בנכסים שקליים.

(2) עודף ההנפקות על הפדיונות בניכוי דיבידנד במזומן.

(3) החל מחודש מארס 1995 חושב שיעור התשואה בהתבסס על מחיר הפדיון של הקרן.

המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית.