

לוח ג'נ'-16

ההתפתחות של קרנות הנאמנות מגן וחשיפה, 1998 עד 2002
(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	לא-צמוד	נכסים פיננסיים עתידיים בארץ	מניות וני"ע להמרה	השקעות בחו"ל	צמוד למט"ח ונקוב במט"ח בארץ	צמוד למדד	לא-צמוד	נכסים פיננסיים 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
11	652	100	0	0	0	0	0	1338	3	0	0	1	0	1342	1998
9.8	-489	99	1	0	0	0	0	921	13	1	0	2	0	937	1999
5.6	-270	99	1	0	0	0	0	701	5	2	0	0	0	708	2000
8	232	88	2	2	0	8	0	396	10	7	0	37	1	451	2001
14.1	967	94	1	0	0	5	0	1313	20	0	0	71	0	1404	2002

2000

1.3	24	98	1	1	0	0	0	729	7	4	0	0	1	741	ינואר
0	-2	99	1	0	0	0	0	728	7	3	0	0	1	739	פברואר
1.1	27	98	1	1	0	0	0	761	8	5	0	1	0	775	מארס
-0.5	11	99	1	0	0	0	0	769	8	3	0	1	0	781	אפריל
0.1	-33	98	1	1	0	0	0	737	6	4	0	1	1	749	מאי
0.6	-2	98	1	1	0	0	0	736	7	5	0	1	4	753	יוני
0.7	47	98	1	1	0	0	0	482	5	6	0	1	-1	493	יולי
0.9	7	97	1	2	0	0	0	311	5	5	0	1	0	322	אוגוסט
2.1	36	97	1	2	0	0	0	340	4	7	0	1	1	353	ספטמבר
-1	-22	98	1	1	0	0	0	319	3	3	0	1	1	327	אוקטובר
-0.1	-7	97	1	1	0	1	0	312	3	3	0	2	0	320	נובמבר
2.5	145	88	2	2	0	8	0	396	10	7	0	37	1	451	דצמבר

2002

2.3	222	89	1	1	0	9	0	607	8	7	0	61	1	684	ינואר
0.8	169	94	1	0	0	5	0	804	6	3	0	44	0	857	פברואר
1.6	452	95	1	1	0	3	0	1288	13	7	0	39	1	1348	מארס
2.5	124	95	1	1	0	3	0	1404	16	11	0	51	1	1483	אפריל
1.6	310	94	1	0	0	5	0	1700	18	7	0	93	0	1818	מאי
0.8	78	94	1	0	0	5	0	1789	26	2	0	95	1	1913	יוני
-0.5	-292	95	0	0	0	5	0	1525	-2	0	0	83	1	1607	יולי
0.3	-133	93	1	0	0	6	0	1373	11	2	0	92	0	1478	אוגוסט
0.2	-4	92	1	0	0	7	0	1291	16	4	0	104	0	1415	ספטמבר
-0.7	26	91	1	0	0	8	0	1306	9	2	0	113	0	1430	אוקטובר
1.2	-64	92	0	0	0	8	0	1271	2	1	0	108	0	1382	נובמבר
3.4	79	94	1	0	0	5	0	1313	20	0	0	71	0	1404	דצמבר

- (1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת כפי שפורסמה בתשקיפי הקרנות.
- (2) קרן מגן - קרן המשקיעה 5-10 אחוזים מנכסיה באופציות מעו"ף ואת היתר הנכסים שקליים.
- (3) עודף ההנפקות על הפדיונות בניכוי דיבידנד במזומן.
- (4) החל מחודש מארס 1995 חושב שיעור התשואה בהתבסס על מחיר הפדיון של הקרן.
- (5) המקור: דיווחי קרנות הנאמנות ליחידת שוק ההון במחלקה המוניטרית של בנק ישראל.