

לוח ג'-נ'-30

הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2002 עד 2006
(מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											
סך הכול	מגן וחשיפה	גמישות	מעורבות	שקלי	חו"ל ⁴	מניות ³	מט"ח	75% אג"ח מדינה	אג"ח ²	מדד	
א. סך כל הנכסים											
45,840	1,404	725	352	21,253	7,168	2,833	6,116	2,232	3,298	459	2002
83,164	1,908	1,289	463	45,873	11,744	6,668	5,171	4,303	5,302	443	2003
101,101	1,623	2,116	857	49,537	15,693	9,500	2,730	6,695	11,989	361	2004
124,621	764	2,645	742	40,265	20,948	9,921	3,305	14,600	30,558	873	2005
111,466	50	3,525	547	32,021	19,479	10,900	1,809	9,738	33,397	-	2006
2005											
105,846	1,601	2,309	916	50,233	15,802	10,046	2,734	7,583	14,238	384	ינואר
111,135	1,532	2,532	967	50,734	15,777	10,509	2,652	8,617	17,345	470	פברואר
115,168	1,431	2,686	918	50,370	15,536	10,684	2,663	9,877	20,405	598	מארס
117,975	1,372	2,751	956	50,389	15,191	10,922	2,676	10,898	22,135	685	אפריל
122,085	1,245	2,873	937	50,464	14,768	10,919	2,705	12,489	24,863	822	מאי
122,720	1,179	2,447	765	50,321	16,639	8,832	4,155	13,374	24,153	855	יוני
125,468	1,118	2,496	781	49,275	17,227	8,998	4,204	14,731	25,688	950	יולי
128,426	1,040	2,525	790	47,785	17,373	9,211	3,960	16,613	28,053	1,076	אוגוסט
131,743	897	2,586	787	45,683	18,121	9,260	3,688	18,428	31,071	1,222	ספטמבר
132,524	850	2,601	786	43,437	18,190	9,354	3,750	19,181	33,134	1,241	אוקטובר
130,249	819	2,660	774	42,313	20,117	9,620	3,739	16,819	32,324	1,064	נובמבר
124,621	764	2,645	742	40,265	20,948	9,921	3,305	14,600	30,558	873	דצמבר
2006											
126,542	721	2,763	728	38,949	24,267	10,308	3,070	14,232	30,691	813	ינואר
125,453	692	2,627	687	38,029	26,626	9,506	2,982	13,519	30,024	761	פברואר
124,837	662	2,650	682	36,709	27,809	9,644	2,910	13,195	29,835	719	מארס
125,529	315	2,853	696	35,861	28,254	10,465	2,573	12,864	30,963	704	אפריל
121,578	284	2,969	978	34,008	25,234	10,543	2,574	12,745	32,243	-	מאי
114,129	273	2,661	885	33,570	22,329	9,233	2,326	11,700	31,152	-	יוני
110,725	256	2,610	827	32,765	21,522	9,331	2,219	11,145	30,050	-	יולי
108,994	248	2,654	805	31,770	21,130	9,308	2,112	11,230	29,737	-	אוגוסט
106,656	244	2,741	739	31,311	20,218	9,394	1,967	11,192	28,850	-	ספטמבר
108,381	244	3,294	745	31,010	19,835	10,703	1,945	10,614	29,991	-	אוקטובר
110,782	246	3,611	724	30,874	19,681	11,306	1,881	10,271	32,188	-	נובמבר
111,466	50	3,525	547	32,021	19,479	10,900	1,809	9,738	33,397	-	דצמבר

(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' 30- (המשך 1)
הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2004 עד 2006
(אחוזים, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											
סך הכול	מגן וחשיפה	מעורבות גמישות	שקלי	חו"ל ⁴	מניות ³	מט"ח	75% אג"ח מדינה	אג"ח ²	מדד		
ב. הרכב תיק הנכסים											
2004											
793	11	38	8	166	200	186	31	57	94	2	מספר הקרנות לסוף התקופה
											ההשקעות בארץ
8.8	0.0	2.1	18.3	0.1	0.0	-0.1	0.3	64.6	32.9	93.6	צמודות למדד
4.7	2.7	2.1	12.9	0.1	12.3	0.6	64.1	1.5	5.2	0.0	מט"ח ונסחרות במט"ח
13.0	0.0	66.5	39.8	0.6	1.7	86.8	3.6	3.5	18.9	2.2	מניות וני"ע בני המרה
0.1	0.9	0.8	0.1	0.0	0.1	0.8	3.8	0.0	-0.7	0.0	נכסים פיננסיים עתידיים
60.4	95.6	20.3	27.4	99.2	8.6	8.9	18.3	29.9	42.0	4.2	נכסים לא-צמודים
13.0	0.8	8.2	1.5	0.0	77.3	3.0	9.9	0.5	1.7	0.0	ההשקעות בחו"ל
2005											
918	6	42	3	168	244	201	30	78	144	2	מספר הקרנות לסוף התקופה
											ההשקעות בארץ
18.2	0.0	6.1	23.3	0.7	0.1	0.3	0.3	60.8	39.8	97.1	צמודות למדד
5.2	2.9	2.8	11.8	0.3	8.8	1.0	67.1	2.4	5.6	-0.1	מט"ח ונסחרות במט"ח
13.3	0.0	67.7	45.1	0.8	1.2	83.8	2.7	3.9	16.1	1.6	מניות וני"ע בני המרה
0.1	1.0	1.2	0.0	0.0	0.0	0.4	1.1	0.0	0.0	0.0	נכסים פיננסיים עתידיים
46.9	95.5	11.8	17.8	98.0	5.8	10.1	13.1	31.5	34.5	0.8	נכסים לא-צמודים
16.3	0.6	10.4	2.0	0.2	84.1	4.4	15.7	1.4	4.0	0.6	ההשקעות בחו"ל
2006											
1038	3	40	6	165	318	207	28	77	194		מספר הקרנות לסוף התקופה
											ההשקעות בארץ
20.7	0.8	4.9	17.1	2.4	0.1	0.5	0.3	64.6	47.3		צמודות למדד
4.6	35.6	1.6	17.5	0.7	7.3	0.7	79.8	2.3	4.6		מט"ח ונסחרות במט"ח
17.6	0.0	73.7	50.4	1.6	1.3	82.5	3.8	4.9	19.2		מניות וני"ע בני המרה
0.0	0.3	0.3	0.0	0.0	-0.2	0.2	0.8	-0.5	0.0		נכסים פיננסיים עתידיים
39.7	56.0	11.4	12.0	94.6	3.1	9.8	10.1	27.4	26.7		נכסים לא-צמודים
17.4	7.3	8.1	3.0	0.7	88.4	6.3	5.2	1.3	2.2		ההשקעות בחו"ל

(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' 30 (המשך 2)
הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2002 עד 2006
(מיליוני ש"ח, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											
התקופה	מדד	אג"ח ²	75% אג"ח מדינה	מט"ח	מניות ³	חו"ל ⁴	שקלי	מעורבות	גמישות	מגן וחשיפה	סך הכול
ג. סך המקורות לפעילות⁵											
2002	-115	-2,538	-1,019	-321	-1,146	2,713	-12,980	-191	-281	967	-14,911
2003	-49	1,793	1,545	524	1,973	2,922	21,497	24	183	331	30,743
2004	164	5,841	2,155	-337	1,618	1,510	1,675	512	711	46	13,895
2005	490	15,807	6,859	377	-1,545	3,855	-9,189	-26	177	-815	15,990
2006	-186	1,555	-7,173	-955	-227	-2,224	-9,189	-302	521	-164	-18,344
2005											
ינואר	19	2,033	638	-18	116	58	642	38	109	-22	3,613
פברואר	83	2,942	962	-76	116	-139	333	40	143	-69	4,335
מארס	128	2,938	1,245	11	233	-64	-472	53	159	-104	4,127
אפריל	84	1,621	969	1	29	-269	-155	25	44	-61	2,288
מאי	132	2,493	1,485	-1	-131	-634	-187	46	76	-130	3,149
יוני	32	-675	758	1,305	-1,425	1,382	31	-150	-316	-68	874
יולי	88	1,184	1,223	92	-275	532	-1,253	-21	-43	-56	1,471
אוגוסט	111	2,082	1,679	-257	-27	28	-1,617	1	-19	-80	1,901
ספטמבר	141	2,714	1,643	-312	-300	468	-2,251	-11	30	-88	2,034
אוקטובר	22	1,259	562	16	46	47	-1,242	1	12	-49	674
נובמבר	-167	-979	-2,224	-6	58	1,566	-864	-13	18	-31	-2,642
דצמבר	-182	-1,802	-2,082	-378	16	878	-2,153	-34	-35	-57	-5,829
2006											
ינואר	-70	-274	-501	-130	-9	2,065	-1,491	-30	-12	-47	-499
פברואר	-48	-586	-634	-81	-546	2,155	-951	-34	-69	-31	-825
מארס	-47	-23	-768	-48	-44	943	-1,367	26	-30	-30	-1,388
אפריל	-22	535	-443	-135	200	669	-1,276	7	68	-7	-404
מאי	-	1268	-740	-101	219	-1997	-1520	-26	122	-3	-2778
יוני	-	-799	-908	-76	-498	-2,322	-439	-64	-139	-6	-5,251
יולי	-	-1,393	-685	-72	-113	-662	-767	-58	-36	-18	-3,804
אוגוסט	-	-240	-416	-41	-23	-619	-833	-26	45	-9	-2,162
ספטמבר	-	-499	-562	-127	-84	-705	-645	-29	29	-5	-2627
אוקטובר	-	629	-693	-33	515	-741	-578	-22	331	-3	-595
נובמבר	-	1884	-375	-55	277	-522	-247	-25	212	-2	1,147
דצמבר	-	1052	-450	-55	-120	-488	924	-21	1	-2	841

(1) קבוצת ההתמחות נקבעה לפי המדיניות המוצהרת שפורסמה בתשקיפי הקרנות.
 (2) קבוצות התמחות אג"ח ואג"ח ח-להמרה.
 (3) התמחות במניות כללי, מעו"ף ואופציות.
 (4) קרנות לתושבי חוץ, קרנות חו"ל וני"ע ישראלים בחו"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' 30 (המשך 3)
הרכב תיק הנכסים והפעילות של קרנות הנאמנות לפי קבוצות התמחות¹, 2002 עד 2006
(אחוזים, מחירים שוטפים)

קבוצת ההתמחות											התקופה
סך הכול	מגן וחשיפה	מעורבות גמישות	שקלי	חור"ל ⁴	מניות ³	מט"ח	75% אג"ח מדינה	אג"ח ²	מדד	מגן וחשיפה	
ד. שיעור התשואה הנומינלי											
-0.5	14.1	-24.0	-13.2	0.7	6.6	-28.1	8.1	-1.8	-1.5	1.6	2002
13.4	11.1	47.4	29.5	12.2	10.5	60.5	-7.8	12.8	13.1	8.5	2003
5.5	5.1	17.1	10.2	3.9	3.3	17.8	-1.6	4.3	6.0	4.5	2004
7.4	2.3	19.6	9.7	3.4	9.5	25.6	8.5	5.4	7.4	4.6	2005
6.5	3.6	18.3	5.4	5.5	4.9	17.3	-4.9	4.0	5.9	2.3	2006
2005											
1.2	0.0	4.1	2.6	0.4	0.1	5.1	1.8	1.3	1.7	1.3	ינואר
0.9	0.4	3.2	1.8	0.4	0.7	3.5	-0.2	0.9	1.1	0.7	פברואר
0.0	0.2	0.1	0.0	0.2	-0.9	-0.2	0.0	0.2	0.2	0.2	מארס
0.5	0.1	0.9	1.3	0.3	-0.5	2.1	0.4	0.5	0.6	0.4	אפריל
0.8	0.3	1.4	0.8	0.6	1.3	1.3	1.3	1.0	0.8	0.8	מאי
0.0	0.3	-3.6	-2.4	0.0	3.4	-6.0	4.5	0.1	-0.3	0.2	יוני
1.1	0.2	3.9	2.7	0.4	0.6	5.2	-0.9	0.9	1.3	0.9	יולי
0.9	0.2	2.0	1.4	0.3	0.6	2.8	0.6	1.4	1.3	1.5	אוגוסט
1.0	0.1	3.1	1.3	0.3	1.8	3.8	1.1	0.5	1.0	0.5	ספטמבר
0.1	0.3	0.1	-0.3	0.1	-0.1	0.4	1.1	-0.1	0.0	-0.3	אוקטובר
0.4	0.0	1.6	0.1	0.0	2.0	2.5	0.4	-0.7	-0.4	-0.8	נובמבר
0.3	0.2	1.5	0.1	0.4	0.1	3.1	-1.7	-0.6	-0.2	-1.0	דצמבר
2005											
2.2	0.6	5.4	2.2	0.4	5.3	4.3	2.4	1.0	1.5	1.2	ינואר
-0.1	0.2	-1.9	-0.8	0.2	0.6	-2.2	0.9	-0.5	-0.3	-0.5	פברואר
0.7	0.3	1.9	1.1	0.2	1.1	2.0	-0.4	0.5	0.7	0.7	מארס
1.1	0.5	5.1	2.8	0.5	-0.7	6.9	-3.5	1.0	1.4	1.0	אפריל
-0.7	0.5	-0.2	-0.7	0.4	-3.0	-1.3	0.2	-0.3	-0.1	-	מאי
-1.6	-1.8	-5.7	-3.3	0.1	-2.5	-7.7	-1.2	-0.5	-1.2	-	יוני
0.4	0.4	1.2	-0.1	0.5	-0.6	2.2	-1.5	0.6	0.5	-	יולי
0.5	0.4	0.8	0.8	0.4	0.7	0.7	0.0	0.4	0.4	-	אוגוסט
0.4	0.4	2.2	0.4	0.6	-0.9	2.4	-1.3	0.2	0.3	-	ספטמבר
2.4	1.4	7.9	3.9	1.0	1.9	8.6	0.5	1.2	1.9	-	אוקטובר
1.3	1.7	3.2	1.2	0.5	2.0	3.2	-0.4	4.0	1.0	-	נובמבר
0.0	-1.0	-2.3	-2.0	0.5	1.4	-2.0	-0.7	0.1	-0.4	-	דצמבר

(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.