

דו"ח בנק ישראל 2005- נספח סטטיסטי

לוח ג'-נ'-51
תוצאות מכרזי האופציות למכירת דולרים לשישה חודשים, 2005

גורם האיזון ²												
רכיב			שער									
			הפרמיות במכרז ¹				החליפין	שער	הכמות	סך כל	הסכום	מספר
שער	רכיב		ממוצעת	מרבית	סגירה	מזערית	היציג ¹	המימוש ¹	הנמכרת	הביקוש	המוצע	המכרזים
סך הכול	הפרמיה		(ש"ח ל-1,000 דולרים)				(ש"ח ל-דולר)		(מיליוני דולרים)			
(אחוזים לשעה"ח של יום המכרז)												
2005												
-1.06	0.47	-1.53	65.78	66.25	65.75	57.00	4.3720	4.393	16	88	16	4 ינואר
-1.09	0.32	-1.41	60.50	60.50	60.50	57.00	4.3693	4.383	16	64	16	4 פברואר
-1.17	0.20	-1.36	58.00	58.00	58.00	56.00	4.3308	4.339	10	72	20	5 מארס
-1.13	0.21	-1.34	57.50	57.50	57.50	57.00	4.3759	4.385	8	32	16	4 אפריל
-1.19	0.12	-1.32	56.80	56.80	56.80	56.00	4.3972	4.403	20	72	28	5 מאי
-1.22	0.05	-1.27	56.33	56.33	56.33	49.00	4.5149	4.517	36	159	48	4 יוני
-1.45	0.00	-1.46	65.12	65.75	65.00	49.00	4.5554	4.556	48	270	48	4 יולי
-1.51	-0.04	-1.47	65.08	65.80	65.00	49.00	4.5199	4.518	60	307	60	5 אוגוסט
-1.45	0.00	-1.45	64.56	64.75	64.50	49.00	4.5353	4.535	48	297	48	4 ספטמבר
-1.40	0.04	-1.44	64.94	65.25	64.75	49.00	4.6136	4.615	48	288	48	4 אוקטובר
-1.41	0.08	-1.48	68.05	68.40	68.00	49.00	4.6944	4.698	60	243	60	5 נובמבר
-1.30	0.18	-1.48	66.75	66.75	66.75	49.00	4.6160	4.625	48	271	48	4 דצמבר

(1) חושב כממוצע משוקלל של תוצאות המכרזים במשך החודש, לפי הכמות הנמכרת בכל מכרז.

(2) נקודת האיזון מוגדרת כפיחות הנדרש בשער החליפין של הדולר כדי שהרווח מהאופציה יהיה אפס.

המקור: עיבודי המחלקה המוניטרית.