|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **בנק ישראל**דוברות והסברה כלכלית | לוגו בנק ישראל | ‏ירושלים, י"ג בתשרי תשע"ח‏‏3 באוקטובר 2017 |

הודעה לעיתונות:

**המסחר בשוק מטבע החוץ בחודש ספטמבר 2017**

# התפתחות שער החליפין – התחזקות השקל מול הדולר לעומת התחזקות הדולר בעולם

במהלך חודש ספטמבר התחזק השקל מול האירו ומול הדולר בשיעור של 2.4% ו-1.9%, בהתאמה.

מול מטבעות שותפות הסחר העיקריות של ישראל, כפי שמשוקלל בשער החליפין הנומינאלי האפקטיבי, התחזק השקל בכ- 2.2%.

בעולם, התחזק הדולר בספטמבר מול רוב המטבעות העיקריים בכלל זה ב- 0.6% מול האירו, ב- 0.6% מול הפרנק השוויצרי, וב-1.9% מול הין היפני; מנגד נחלש הדולר ב-4.4% מול הפאונד הבריטי.

# תנודתיות שע"ח –עליה בסטיית התקן בפועל במקביל לעליה בסטיית התקן הגלומה

סטיית התקן של השינוי בשער החליפין שקל/דולר – המייצגת את התנודתיות **בפועל** בשער החליפין – עלתה החודש בכ- 0.5 נקודת האחוז ועמדה בסוף חודש ספטמבר על 6.7%.

רמתה הממוצעת של סטיית התקן הגלומה במסחר באופציות על שקל/דולר "מעבר לדלפק" עלתה החודש בכ-0.1 נקודת אחוז ועמדה בסוף ספטמבר על 7.5%.

במקביל, סטיות התקן הגלומות באופציות על מט"ח בשווקים מתעוררים ומפותחים עלו אף הן, ועמדו בסוף החודש על רמה ממוצעת של 8.9% ו- 8.5% בהתאמה (ראה תרשים 4).

סטיית התקן הגלומה במסחר באופציות על שער החליפין מייצגת את התנודתיות **הצפויה** בשער החליפין.

# נפח המסחר בשוק המט"ח– ירידה בנפח המסחר הכולל במקביל לירידה בחלקם של תושבי חוץ בנפח המסחר הכולל

**נפח המסחר הכולל** במטבע חוץ בחודש ספטמבר הסתכם בכ-123 מיליארדי דולרים, בהשוואה לכ-147 מיליארדים בחודש אוגוסט[[1]](#footnote-1). נפח המסחר היומי הממוצע עלה בכ-8% ועמד על 7.2 מיליארד דולר ביום.

**נפח המסחר בעסקות המרה** (עסקות ספוט ועסקות פורוורד) הסתכם בחודש ספטמבר בכ-27 מיליארדי דולרים. הממוצע היומי של נפח המסחר בעסקאות המרה עלה בספטמבר בכ-7% בהשוואה לחודש אוגוסט.

**נפח המסחר באופציות למט"ח "מעבר לדלפק"** (אופציות שלא נסחרות בבורסה לני"ע) הסתכם בחודש ספטמבר ב- 7.1 מיליארדי דולרים. הממוצע היומי של נפח המסחר בחודש ספטמבר עלה בהשוואה לאוגוסט ועמד על כ- 415 מיליוני דולרים.

**נפח המסחר בעסקות החלף** הסתכם בספטמבר בכ- 88 מיליארדי דולרים, בהשוואה לכ-106 מיליארדים באוגוסט.

הממוצע היומי של נפח המסחר בעסקות החלף עלה בכ-7% מחודש שעבר ועמד על 5.2 מיליארדי דולרים ביום.

**חלקם היחסי של תושבי חוץ בנפח המסחר הכולל** (עסקות המרה, עסקות באופציות ועסקות החלף) ירד ועמד בסוף חודש ספטמבר על כ- 36%. הירידה נבעה מקיטון בהיקף הפעילות של תושבי חוץ בעסקאות המרה והחלף.

## לוחות ותרשימים

****

****

****

****





1. נציין כי בעקבות חגי תשרי בחודש ספטמבר שעות המסחר היו מצומצמות בהשוואה לחודש שעבר. [↑](#footnote-ref-1)