

לוח ג-נ'-54

תוצאות מכרזי האופציות לרכישת דולרים לשלושה חודשים, 2004

גורם האיזון ²														
רכיב				שער										
רכיב				הפרמיות במכרז ¹				החליפין		שער	הכמות	סך כל	הסכום	מספר
הפרמיה				מזערית				היציג ¹		המימוש ¹	הנמכרת	הביקוש	המוצע	המכרזים
סך הכול														
(אחוזים לשער החליפין של יום המכרז)				(ש"ח ל-1,000 דולרים)				(ש"ח ל-דולר)		(מיליוני דולרים)				
האופציות מחוץ לכסף														
2004														
ינואר	8	32	144.2	32	4.4660	4.4278	35.75	53.50	55.87	53.59	1.22	0.86	2.09	
פברואר	8	32	177.1	32	4.5030	4.4660	36.00	51.75	52.62	51.81	1.17	0.83	2.00	
מארס	9	36	176.0	36	4.5350	4.4995	36.00	46.22	48.00	46.31	1.04	0.78	1.82	
אפריל	7	36	120.1	36	4.5830	4.5488	36.56	45.56	46.11	45.58	1.01	0.75	1.76	
מאי	7	28	144.1	28	4.6340	4.5999	37.00	48.00	49.00	48.04	1.06	0.74	1.79	
יוני	9	36	155.1	36	4.5510	4.5212	36.22	43.56	44.67	43.59	0.97	0.67	1.64	
יולי	8	36	188.1	36	4.5230	4.4946	36.00	40.22	42.00	40.37	0.91	0.62	1.53	
אוגוסט	9	36	152.0	36	4.5590	4.5316	36.50	40.25	41.12	40.27	0.90	0.61	1.50	
ספטמבר	6	36	168.0	36	4.5190	4.4939	36.00	38.33	39.89	38.37	0.86	0.56	1.42	
אוקטובר	7	32	198.0	32	4.4800	4.4573	36.00	41.88	43.13	41.95	0.95	0.51	1.47	
נובמבר	7	28	180.0	28	4.4140	4.3944	35.29	44.86	46.00	45.05	1.04	0.44	1.48	
דצמבר	9	36	230.0	36	4.3590	4.3451	35.00	48.00	48.22	48.03	1.12	0.31	1.43	

(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.