

לוח ג'-נ'-56
תוצאות מכרזי האופציות לרכישת דולרים לשישה חודשים, 2004

גורם האיזון ²												
רכיב			שער									
שער		רכיב	הפרמיות במכרז ¹				החליפין	שער	הכמות	סך כל	הסכום	מספר
סך הכול	המימוש	הפרמיה	ממוצעת	מרבית	סגירה	מזערית	היציג ¹	המימוש ¹	הנמכרת	הביקוש	המוצע	המכרזים
(אחוזים לשעה"ח של יום המכרז)			(ש"ח ל-1,000 דולרים)				(ש"ח ל-דולר)		(מיליוני דולרים)			
2004												
ינואר	4	16	72	16	4.492	4.4165	58.50	76.00	77.50	76.04	1.76	3.48
פברואר	4	16	96	16	4.539	4.464	59.00	74.75	76.25	74.82	1.71	3.40
מרס	5	20	112.2	20	4.571	4.4989	59.20	72.20	74.60	72.27	1.64	3.25
אפריל	4	16	56	16	4.615	4.5461	60.25	72.25	72.25	72.25	1.62	3.13
מאי	4	16	72.1	16	4.67	4.6015	60.75	72.75	73.50	72.77	1.62	3.11
יוני	5	20	80	20	4.576	4.5169	59.60	70.60	71.60	70.62	1.60	2.90
יולי	4	16	89	16	4.546	4.4906	59.25	65.25	66.50	65.31	1.49	2.72
אוגוסט	5	20	104	20	4.584	4.5298	59.80	65.80	66.80	65.84	1.48	2.68
ספטמבר	4	16	80	16	4.543	4.4924	59.00	65.75	65.75	65.75	1.50	2.61
אוקטובר	4	16	96	16	4.502	4.4568	58.75	68.50	69.00	68.54	1.57	2.57
נובמבר	4	16	84	16	4.436	4.3978	57.75	65.50	66.75	65.53	1.52	2.39
דצמבר	4	16	96	16	4.37	4.3434	57.00	67.25	67.75	67.26	1.58	2.19

- (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.