|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **בנק ישראל**  דוברות והסברה כלכלית | לוגו בנק ישראל | ‏ירושלים, ט"ו בתמוז, תשע"ז  ‏‏09 ביולי 2017 |

הודעה לעיתונות:

**המסחר בשוק מטבע החוץ בחודש יוני 2017**

# התפתחות שער החליפין – התחזקות השקל מול הדולר במקביל להיחלשות הדולר בעולם

במהלך חודש יוני התחזק השקל מול הדולר בשיעור של 1.8% ונחלש מול האירו בשיעור של 0.5%.

מול מטבעות שותפות הסחר העיקריות של ישראל, כפי שמשוקלל בשער החליפין הנומינאלי האפקטיבי, התחזק השקל בכ- 0.9%.

בעולם, נחלש הדולר ביוני מול רוב המטבעות העיקריים בכלל זה ב- 2.2% מול האירו, ב- 1.0% מול הפאונד הבריטי, וב-1.8% מול הפרנק השוויצרי; מנגד התחזק הדולר ב-0.8% מול הין היפני.

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

סטיית התקן של השינוי בשער החליפין שקל/דולר – המייצגת את התנודתיות **בפועל** בשער החליפין – עלתה החודש בכ- 1.2 נקודת האחוז ועמדה בסוף חודש יוני על 4.4%.

רמתה הממוצעת של סטיית התקן הגלומה במסחר באופציות על שקל/דולר "מעבר לדלפק" ירדה החודש בכ-0.3 נקודת אחוז ועמדה בסוף יוני על 6.9%.

במקביל, סטיות התקן הגלומות באופציות על מט"ח בשווקים מתעוררים ומפותחים ירדו אף הן, ועמדו בסוף החודש על רמה ממוצעת של 8.7% ו- 7.2% בהתאמה (ראה תרשים 4).

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

# נפח המסחר בשוק המט"ח– עליה בנפח המסחר הכולל במקביל לעליה בחלקם של תושבי חוץ בנפח המסחר הכולל

**נפח המסחר הכולל** במטבע חוץ בחודש יוני הסתכם בכ-146 מיליארדי דולרים, בהשוואה לכ-139 מיליארדים בחודש מאי. נפח המסחר היומי הממוצע ירד בכ-9% ועמד על 6.6 מיליארד דולר ביום.

**נפח המסחר בעסקות המרה** (עסקות ספוט ועסקות פורוורד) הסתכם בחודש יוני בכ-29 מיליארדי דולרים. הממוצע היומי של נפח המסחר בעסקאות המרה ירד ביוני בכ-10% בהשוואה לחודש מאי.

**נפח המסחר באופציות למט"ח "מעבר לדלפק"** (אופציות שלא נסחרות בבורסה לני"ע) הסתכם בחודש יוני ב- 6.3 מיליארדי דולרים. הממוצע היומי של נפח המסחר בחודש יוני ירד בהשוואה למאי ועמד על כ- 289 מיליוני דולרים.

**נפח המסחר בעסקות החלף** הסתכם ביוני בכ- 110 מיליארדי דולרים, בהשוואה לכ-105 מיליארדים במאי.

הממוצע היומי של נפח המסחר בעסקות החלף ירד בכ-9% מחודש שעבר ועמד על 5 מיליארדי דולרים ביום.

**חלקם היחסי של תושבי חוץ בנפח המסחר הכולל** (עסקות המרה, עסקות באופציות ועסקות החלף) עלה ועמד בסוף חודש יוני על כ- 34%. העלייה נבעה מגידול בהיקף הפעילות של תושבי חוץ בעסקאות המרה והחלף.

## תרשים 1: מדד שקל/דולר ושער החליפין הנומינלי אפקטיבי לוחות ותרשימים

**תרשים 2: שיעורי השינוי של הדולר כנגד מטבעות שונים -יוני 2017
**

**תרשים 3: סטיית התקן של השינוי בשער חליפין (עבור 20 ימי מסחר אחרונים)
**

**תרשים 4: השוואה בינלאומית של סטיית התקן הגלומה באופציות על מטבע חוץ
**

תרשים 5 : חלקם של תושבי חוץ בנפח המסחר הכולל


עסקות במט"ח עם הבנקים המקומיים לפי מכשירים ומגזרים (במיליוני דולרים)