

לוח ג'-נ'-55
תוצאות מכרזי האופציות למכירת דולרים לשלושה חודשים, 2004

גורם האיזון ²													
רכיב													
שער													
הפרמיות במכרז ¹													
מספר													
התקופה													
המכרזים													
המוצע													
הביקוש													
הנמכרת													
המימוש ¹													
היצ'ג ¹													
החליפין													
מזערית													
סגירה													
מרבית													
ממוצעת													
הפרמיה													
המימוש													
סך הכול													
(מיליוני דולרים)													
(ש"ח ל-דולר)													
(ש"ח ל-1,000 דולרים)													
(אחוזים לשעה"ח של יום המכרז)													
האופציות מחוץ לכסף													
2004													
ינואר	8	32	144	32	4.4660	4.4278	35.75	52.00	52.37	52.03	-1.19	0.86	-0.33
פברואר	8	32	176	32	4.5030	4.4660	36.00	52.12	52.75	52.21	-1.18	0.83	-0.35
מארס	9	36	176	36	4.5350	4.4995	36.00	44.67	45.22	44.69	-1.00	0.78	-0.22
אפריל	7	36	128	36	4.5830	4.5488	36.56	44.11	44.44	44.13	-0.98	0.75	-0.23
מאי	7	28	144	28	4.6340	4.5999	37.00	48.43	48.71	48.44	-1.06	0.74	-0.32
יוני	9	36	170	36	4.5510	4.5212	36.22	46.00	46.11	46.01	-1.03	0.67	-0.36
יולי	8	36	132	36	4.5260	4.4976	36.00	37.25	39.12	37.51	-0.84	0.63	-0.22
אוגוסט	9	36	124	36	4.5630	4.5358	36.71	37.43	37.71	37.54	-0.84	0.61	-0.23
ספטמבר	6	36	130	36	4.5190	4.4939	36.00	37.22	37.33	37.25	-0.84	0.56	-0.28
אוקטובר	7	32	147	32	4.4800	4.4573	36.00	37.57	37.57	37.57	-0.85	0.51	-0.34
נובמבר	7	28	200	28	4.4140	4.3944	35.29	45.00	45.43	45.21	-1.04	0.44	-0.60
דצמבר	9	36	229	36	4.3590	4.3451	35.00	50.44	50.44	50.44	-1.17	0.31	-0.86

(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.