

לוח ג'-נ'-57
תוצאות מכרזי האופציות למכירת דולרים לשישה חודשים, 2004

גורם האיוון ²			שער										
רכיב			הפרמיות במכרז ¹				החליפין	שער	הכמות	סך כל	הסכום	מספר	התקופה
שער	רכיב		ממוצעת	מרבית	סגירה	מזערית	היציג ¹	המימוש ¹	הנמכרת	הביקוש	המוצע	המכרזים	
סך הכול	הפרמיה	המימוש	(ש"ח ל-1,000 דולרים)				(ש"ח ל-דולר)		(מיליוני דולרים)				
(אחוזים לשעה"ח של יום המכרז)													
2004													
-0.09	1.72	-1.81	78.00	78.00	78.00	58.50	4.4165	4.492	16	72	16	4	ינואר
-0.10	1.69	-1.78	77.87	78.25	77.50	59.00	4.464	4.539	16	96	16	4	פברואר
0.00	1.61	-1.61	70.80	70.80	70.80	59.20	4.4989	4.571	20	112	20	5	מארס
-0.03	1.51	-1.54	68.76	69.00	68.75	60.25	4.5461	4.615	16	56	16	4	אפריל
-0.16	1.49	-1.65	74.29	75.25	74.25	60.75	4.6015	4.67	16	72	16	4	מאי
-0.25	1.30	-1.55	68.40	68.40	68.40	59.60	4.5169	4.576	20	80	20	5	יוני
-0.14	1.23	-1.37	60.36	62.00	60.25	59.25	4.4906	4.546	16	58	16	4	יולי
-0.17	1.19	-1.37	60.64	61.20	60.60	59.80	4.5298	4.584	20	88	20	5	אוגוסט
-0.29	1.11	-1.40	61.75	61.75	61.75	59.00	4.4924	4.543	16	72	16	4	ספטמבר
-0.42	1.02	-1.43	62.58	62.67	62.33	58.67	4.4567	4.502	12	64	16	4	אוקטובר
-0.67	0.87	-1.54	66.50	66.50	66.50	57.75	4.3978	4.436	16	91	16	4	נובמבר
-1.06	0.61	-1.67	71.00	71.00	71.00	57.00	4.3434	4.37	16	96	16	4	דצמבר

- (1) חושב כממוצע משוקלל של תוצאות המכרזים במשך החודש, לפי הכמות הנמכרת בכל מכרז.
(2) נקודת האיוון מוגדרת כפיחות הנדרש בשער החליפין של הדולר כדי שהרווח מהאופציה יהיה אפס.
המקור: עיבודי המחלקה המוניטרית.