

המסחר בנגזרים על ת"א-25, 1993 עד 2005

(מחירים שוטפים)

31.12.2005

חוזים עתידיים על מדד ת"א 25		אופציות על מדד ת"א - 25							התקופה	
		מס' חשבונות לקוחות מקסימלי	מס' חוזים פתוחים מקסימלי (באלפים)	ממוצע יומי		סה"כ מחזור במונחי נכס בסיס (מיליארדי ש"ח)				סה"כ מחזור ביחידות אופציה (באלפים)
מס' חוזים פתוחים מקסימלי (באלפים)	מחזור ביחידות (באלפים)			מספר עסקאות	מחזור ביחידות (באלפים)	% ממחזור מניות ת"א-25 משוקלל דלתא ⁽¹⁾	% ממחזור מניות מעו"ף			
-	-	2,590	32	615	3	13%	27%	3	124	1993
-	-	11,723	276	1,428	18	177%	399%	81	4,326	1994
0.4	1.1	10,383	322	1,988	23	421%	945%	103	5,654	1995
0.7	2.1	8,076	322	2,195	24	476%	1,110%	120	5,814	1996
0.2	0.2	8,482	329	2,416	24	340%	791%	162	5,743	1997
2.9	6.7	7,885	345	2,916	31	338%	786%	234	7,615	1998
3.4	12.3	8,198	505	3,866	45	417%	1,106%	433	10,980	1999
13.9	121.9	12,056	659	10,308	109	855%	2,255%	1,403	26,971	2000
10.5	69.4	8,476	570	12,466	110	1,000%	2,531%	1,138	26,872	2001
6.0	33.3	7,747	605	14,861	118	1,059%	2,661%	1,142	29,422	2002
4.5	10.9	7,963	619	16,972	120	806%	2,057%	1,195	29,353	2003
5.7	8.3	8,515	826	20,363	153	859%	2,214%	2,003	36,915	2004
										2005
5.1	0.1	8,663	761	29,688	204	871%	2,294%	280	4,479	ינואר
5.1	0.1	9,186	698	29,670	217	776%	2,645%	279	4,341	פברואר
0.1	0.0	8,623	735	28,495	196	1,087%	2,766%	293	4,501	מרץ
0.1	0.0	8,422	741	29,036	201	1,381%	3,371%	249	3,825	אפריל
0.0	0.0	8,215	769	29,018	200	1,156%	2,837%	283	4,209	מאי
1.2	1.2	8,970	841	41,450	286	1,124%	2,846%	380	5,729	יוני
2.6	2.0	11,211	1,055	48,961	318	1,357%	3,779%	444	6,675	יולי
4.5	2.0	10,930	917	49,466	311	1,225%	3,693%	480	6,841	אוגוסט
4.0	2.0	9,777	765	45,168	276	1,090%	2,973%	424	5,798	ספטמבר
5.1	1.2	9,425	691	46,556	288	1,266%	3,436%	283	3,745	אוקטובר
2.9	2.6	9,083	792	51,565	319	1,180%	3,481%	533	7,010	נובמבר
4.1	2.3	11,987	934	44,912	283	1,164%	3,225%	483	5,944	דצמבר
5.1	13.5	11,987	1,055	39,499	258	1,140%	3,115%	4,411	63,097	סה"כ 2005

(1) יחס המשוקלל בהסתברות המימוש של האופציות.