

המסחר בנגזרים על ת"א-25, 1993 עד 2006

(מחירים שוטפים)

31.12.2006

חוזים עתידיים על מדד ת"א 25		אופציות על מדד ת"א - 25							התקופה	
מס' חוזים פתוחים מקסימלי (באלפים)	מחזור ביחידות (באלפים)	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)
				מספר עסקאות	מחזור ביחידות (באלפים)	% ממחזור מניות ת"א-25 משוקלל דלתא ⁽¹⁾	% ממחזור מניות מעו"ף	סה"כ מחזור		
-	-	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
5.1	13.5	11,987	1,055	39,346	258	1,126%	3,115%	4,411	63,097	2005
										2006
7.2	5.4	11,197	941	55,676	338	986%	2,968%	647	7,764	ינואר
7.2	4.6	10,757	923	54,342	313	1,246%	3,487%	502	6,263	פברואר
4.1	1.7	9,958	875	47,825	276	1,228%	3,393%	456	5,515	מרץ
2.4	0.2	9,342	761	42,516	255	1,153%	3,127%	367	4,338	אפריל
2.4	2.9	9,301	900	59,496	357	1,084%	3,051%	658	7,501	מאי
7.0	5.4	11,770	1,075	55,403	323	1,338%	3,958%	526	6,451	יוני
4.2	3.8	13,010	1,080	66,661	400	1,186%	3,681%	692	8,797	יולי
3.7	3.3	10,882	789	46,828	268	1,093%	3,185%	475	5,897	אוגוסט
2.9	0.2	9,131	783	45,579	262	1,246%	3,278%	402	4,971	ספטמבר
2.2	2.2	8,680	797	49,526	280	1,220%	3,255%	513	5,883	אוקטובר
1.7	0.3	10,273	895	54,000	303	1,189%	3,321%	610	6,660	נובמבר
2.7	2.5	9,568	965	43,911	259	1,312%	3,619%	509	5,446	דצמבר
7.2	32.5	13,010	1,080	52,085	305	1,187%	3,339%	6,356	75,487	סה"כ 2006

(1) יחס המשוקלל בהסתברות המימוש של האופציות.