

המסחר בנגזרים על ת"א-25, 1993 עד 2007

(מחירים שוטפים)

31.12.2007

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 במונחי נכס בסיס		
-	-	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
7.2	32.5	13,010	1,080	52,085	305	1,187%	3,339%	6,356	75,487	2006
5.9	20.0	14,391	1,317	76,509	385	1,351%	3,842%	10,283	94,280	2007
2007										
4.9	3.2	9,724	930	53,620	316	1,180%	3,220%	681	7,278	ינואר
5.9	3.5	10,164	969	61,221	342	1,125%	3,112%	674	6,842	פברואר
4.1	0.6	12,235	1,117	78,797	439	1,487%	4,322%	849	8,778	מרץ
2.9	0.1	10,765	941	65,167	348	1,231%	3,395%	585	5,572	אפריל
2.0	1.7	11,036	936	75,156	371	1,116%	3,263%	860	7,789	מאי
1.3	0.8	11,092	919	83,204	409	1,729%	5,107%	913	8,178	יוני
2.8	2.0	10,401	884	66,450	333	1,287%	3,626%	835	7,325	יולי
2.7	1.6	14,391	1,317	86,668	438	1,509%	4,498%	1,029	9,642	אוגוסט
1.6	0.6	11,260	1,076	81,755	414	1,622%	4,766%	760	7,030	ספטמבר
1.1	1.0	11,285	1,076	87,737	424	1,373%	3,990%	1,060	8,908	אוקטובר
1.2	0.7	12,022	1,109	91,321	417	1,322%	3,841%	1,048	8,755	נובמבר
3.8	4.2	11,048	936	86,699	371	1,282%	3,530%	989	8,184	דצמבר
5.9	20.0	14,391	1,317	76,509	385	1,351%	3,842%	10,283	94,280	סה"כ 2007

(1) יחס המשוקלל בהסתברות המימוש של האופציות.