

המסחר בנגזרים על ת"א-25, 1993 עד 2002
(מחירים שוטפים)

31.12.2002

חוזים עתידיים על		אופציות על מדד ת"א - 25							התקופה	
מדד ת"א 25		מס' חשבונות	מס' חוזים	ממוצע יומי		סה"כ מחזור במונחי נכס בסיס			סה"כ מחזור	
מס' חוזים	מחזור	לקוחות	פתוחים	מספר	מחזור	% ממחזור	% ממחזור	(מיליארדי ש"ח)	ביחידות	
פתוחים	ביחידות	מקסימלי	מקסימלי	עסקאות	ביחידות	מניות ת"א-25	מניות מעו"ף		אופציה	
מקסימלי	(באלפים)		(באלפים)		(באלפים)	משוקלל דלתא ⁽¹⁾			(באלפים)	
(באלפים)										
-	-	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
										2002
3.1	2.1	7,617	605	16,083	147	1,065%	2,952%	157	3,372	ינואר
2.5	1.7	7,098	558	16,728	144	1,040%	2,722%	119	2,745	פברואר
1.4	1.6	7,220	500	15,144	131	1,002%	2,730%	104	2,484	מרץ
1.0	1.6	7,747	490	16,203	126	989%	2,568%	89	2,271	אפריל
4.9	6.0	6,759	456	13,794	102	848%	2,180%	83	2,132	מאי
4.3	1.4	6,374	467	12,377	98	1,009%	2,430%	75	2,059	יוני
5.4	2.8	6,638	460	16,228	129	1,048%	2,737%	106	2,840	יולי
2.1	1.7	6,233	440	12,256	92	1,099%	2,667%	71	1,922	אוגוסט
1.5	1.0	5,864	413	12,543	93	1,177%	2,744%	63	1,761	ספטמבר
6.0	7.5	6,104	448	14,261	105	1,323%	3,023%	81	2,405	אוקטובר
3.2	0.7	5,752	446	15,138	112	986%	2,352%	78	2,239	נובמבר
4.5	5.2	6,434	594	17,579	139	1,122%	2,743%	115	3,191	דצמבר
6.0	33.3	7,747	605	14,861	118	1,059%	2,661%	1,142	29,422	סה"כ 2002

(1) יחס המשוקלל בהסתברות המימוש של האופציות.