

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.