



16/9/2022

סיכום ישיבת וועדת התלבור שהתקיימה ב-15/9/22

נוכחים מקרב חברי הוועדה: מימי רגב (יו"ר הוועדה), חטיבת השווקים - בנק ישראל
אייל קליין, נציג ACI Israel (פורקס)
קטי כהן, חטיבת השווקים - בנק ישראל

משתתפים נוספים: רן אברהם, בנק מזרחי-טפחות
יוסי קואמו, בנק הפועלים
חלי סימן טוב, בנק הפועלים
צח שרון, בנק לאומי
איאן קלוטניק, בנק דיסקונט
רמי אוגדן, הבנק הבינלאומי
שוקי חי, הבנק הבינלאומי
צילה בילט בלנק, חטיבת השווקים - בנק ישראל

הנושאים שנדונו:

1. הוצג כי ISDA צפוי לצרף את ריבית SHIR בעדכון הקרוב שיפורסם באוקטובר.
2. הוצגה סוגיית ה-Fall back כאשר Bloomberg, המשמשים כ-Fallback Adjustment Vendor, התפתח דיון לגבי הנחיצות של מנגנון Fall back בריבית תלבור, שהיא שונה מריביות ה-libor האחרות מתוקף היותה מוגבלת לעסקאות בנגזרים בלבד ועל כן לא מתמחרת את סיכון האשראי. סוכם לקיים דיון נוסף בנושא.
3. הוצגה הבקשה של בלומברג לקביעת הפרמטרים השונים באפיון עסקאות IRS ובייסיס ב-SHIR. ה-templates כפי שגובשו ע"י איאן קלוטניק מבנק דיסקונט, יועברו למשתתפים לאחר הישיבה לעיון.

החלטות שהתקבלו בישיבה זו :

אין