

ירושלים, ח' שבט תשס"ב

21 בינואר 2002

חוזר מס' ח-06-2065

לכבוד

התאגידים הבנקאיים

הנדון: זוח רבעוני על הקצאת הון בגין חשיפה לסיכונים שוק.

הוראות הדיווח לפיקוח על הבנקים – הוראה מס' 812 A

מבוא

1. עקב הניסיון שנצבר בפיקוח על הבנקים הוחלט לעדכן את ההוראה.

התיקונים להוראות

2. בתחילת לוחות 01 ו-02 יתווספו 2 טורים לפירוט הפוזיציות לפני השקלול. (כלומר: לפני ההכפלה במקדמי הסיכון הרלבנטיים). טור 10 יבוטל ותתווספה הערות שוליים המסבירות את החישוב בטור האחרון.

3. בלוח 04 שורות 18 – 14 ימוספרו 20 – 16 ולפניהן יתווספו 2 שורות דיווח על דרישת ההון בגין סיכון שער חליפין ועל דרישת ההון בגין סיכון אינפלציה. שורות אלו יחושבו אוטומטית.

4. בלוח 08:

" . יתווספו שורות דיווח בהן יפורטו סיכונים הריבית לפי מגזרי הצמדה ויפורטו סיכונים שע"ח ואינפלציה לפי מרכיביהם. שורות אלו יחושבו אוטומטית. כתוצאה מכך ישתנה מספור השורות ועמו ההנחיות בסעיפים 19 ו-20 בהוראה.

" . התווספה שורת סיכום אוטומטי בגין חברות בת שסיכונים השוק שלהן אינם מנוהלים ע"י התאגיד הבנקאי באופן שוטף על בסיס מאוחד.

" . התווספה שורת דיווח על יחס ההון המזערי הנדרש ע"י התאגיד הבנקאי המדווח. זאת משום שלתאגידים בנקאיים שונים נקבע יחס הון מזערי שונה. הסכום המשוקלל במונחי נכסי סיכון ("סיכון שוק") יחושב אוטומטית בשורה 33.

שאלות וביירוים

5. בדבר שאלות וביירוים יש לפנות לגבי מרב שמש בטלפון 02 6552405 - או בפקס 02-6552159.

תחילה

6. תחילתם של התיקונים על פי חוזר זה מהדיווח ליום 31.3.02.

עדכון הקובץ

7. מצ"ב דפי עדכון, להלן הוראות העדכון:

<u>להכניס עמוד</u>	<u>להוציא עמוד</u>
(1/02) [37] 803-1	(1/02) [36] 803-1
(1/02) [35] 803-2	(12/01) [34] 803-2
(1/02) [36] 803-3	(1/02) [35] 803-3
(1/02) [35] 803-4	(1/02) [34] 803-4
(1/02) [3] 812A-3	(12/00) [2] 812A-3
(1/02) [2] 812A-4,5	(9/00) [1] 812A-4,5
(1/02) [2] 812A-7	(12/00) [1] 812A-7
# (1/02) [4] 865-26	(3/98) [3] 865-26
(1/02) [2] 897-30	(1/02) [1] 897-30

תיקון טכני

בכבוד רב,

רפאל לנקרי
הממונה על ההסדרה

(ל-2306)