

פעילות בשוק מעו"ף

מבוא

1. פעילות התאגיד הבנקאי בשוק מעו"ף תתבצע בכפוף להוראות הבורסה וחוקי העזר של מסלוקת מעו"ף בע"מ.
בנוסף, לאור הסיכונים הכרוכים בפעילות זו ועל מנת להבטיח ניהול זהיר ותקין של עסקי התאגיד הבנקאי בתחום זה, יש לנקוט בין היתר בצעדים המפורטים בהוראה זו.

הגדרות

2. "אופציה"-
כמשמעותה בחוקי העזר של מסלוקת מעו"ף ;
"הון התאגיד הבנקאי"-
כמשמעותו בהוראה מס' 311, נספח א' ;
"התחייבויות כלפי מסלוקת מעו"ף"-
(א) התחייבויות התאגיד הבנקאי כלפי מסלוקת מעו"ף בגין תיק אופציות של לקוחותיו, של עצמו או של תאגיד בנקאי אחר שהוא ערב לו בסכום הבטוחות הנדרש לפי התרחישים כמפורט בחוקי העזר של מסלוקת מעו"ף ;
(ב) התחייבויות התאגיד הבנקאי כלפי קרן הסיכונים של מסלוקת מעו"ף ;
"חבר נלווה"-
חבר הבורסה לניירות ערך בתל אביב, שאינו חבר מסלוקת מעו"ף ;
"יצירת אופציה"-
נטילת התחייבות כלפי מסלוקת מעו"ף לקיים את התחייבותה על פי אופציה כקבוע בתנאי האופציה ;
"מסלוקת מעו"ף"-
מסלוקת מעו"ף בע"מ, הסולקת עסקאות באופציות ובחוזים עתידיים ;
"פעילות בשוק מעו"ף"-
יצירת אופציה או מסחר בה במסגרת הבורסה המנוהלת על ידי מסלוקת מעו"ף בע"מ.

הערכות ארגונית

3. תאגיד בנקאי לא יקיים פעילות בשוק מעו"ף עבור עצמו ועבור לקוחותיו ללא הערכות מתאימה בתחום המקצועי, המיכוני והניהולי.

נוהלי עבודה

4. בנוהלי העבודה הפנימיים של התאגיד הבנקאי יודגשו בין היתר הנושאים הבאים :

(א) מסגרת לפעילות בשוק מעו"ף

- (1) ייקבעו הגורמים ומדרג הסמכויות לאשור מסגרת פעילות ללקוח היוצר אופציות ושל רמת סוג הבטוחות הנדרשות להבטחת פעילות זו ;
- (2) לא יאפשר התאגיד הבנקאי ללקוח ליצור אופציות בטרם אושרה לו מסגרת פעילות ;
- (3) תיקבענה רמות חשיפה מותרות להתחייבות התאגיד הבנקאי על חשבון עצמו ("נוסטרו") כלפי מסלקת מעו"ף.

(ב) תפעול, פיקוח ובקרה

- (1) ייקבעו האמצעים והגורמים לפיקוח ומעקב שוטף אחר הפעילות בשוק מעו"ף ורמת הבטוחות הנגזרת ממנה.
- (2) ייקבעו הגורם האחראי לסגירת פוזיציות של לקוח שחרג מהמסגרת המאושרת וכן אופן הסגירה ועיתויה.

חבר נלווה

5. (א) תאגיד בנקאי לא יספק שרותי סליקה לעסקות באופציות מעו"ף לחבר נלווה וללקוחותיו ללא התקשרות חוזית.
- (ב) בהסכם ההתקשרות יפורטו האמצעים שהתאגיד הבנקאי רשאי לנקוט על מנת למנוע ולהקטין חריגות של חבר נלווה או לקוחותיו ממסגרת הפעילות והבטוחות שאושרה.

חשיפה כוללת

6. סך כל התחייבויותיו של תאגיד בנקאי כלפי מסלקת מעו"ף בניכוי אותן התחייבויות בגין לקוחותיו המכוסות בבטוחות המוכרות כניכויים לפי סעיף 5 להוראה מס' 313 (מגבלות על חבות של לווה ושל קבוצת לווים), לא יעלה על 30% מהונו של התאגיד הבנקאי.

* * *

עדכונים

תאריך	פרטים	גרסה	חוזר 06 מס'
11/7/94	הוראה מקורית	1	1715
12/95	גרסה מחודשת של קובץ ניהול בנקאי תקין	2	----