

סיכום הישיבה שוועדת התלבור קיימה ב-10/7/2018

נוכחים מקרב חברי הוועדה: רועי שטיין (יו"ר), חטיבת המחקר של בנק ישראל

צחי אליאש, נשיא ACI Israel (פורקס)

שרון לביא, הבורסה לניירות ערך

קטי כהן, חטיבת השווקים של בנק ישראל

רן אברהם, בנק מזרחי-טפחות

צח שרון, בנק לאומי

יעקב גדנקן, בנק דיסקונט

יאן קלוטניק, בנק דיסקונט

שוקי חי, הבנק הבינלאומי

אידיט מוסקוביץ', הבנק הבינלאומי

מימי רגב, חטיבת השווקים של בנק ישראל

מיכל רוט-לוי, בנק הפועלים

משתתפים נוספים:

נעדרו:

הנושאים שנדונו:

1. באפריל 2015 החליטה הוועדה לצמצם את המרווח בעסקאות המחייבות ל-4 נקודות בסיס (± 2), הן בעסקאות הלוואה ופיקדון ליום עסקים אחד והן בעסקאות בנגזרי ריבית, וזאת כדי לשמר את האפקטיביות של המחויבות לבצע עסקאות על בסיס ציטוטי התלבור גם בסביבת ריביות קרובה מאוד לאפס. מאחר שארה"ב העלתה את הריבית והתגברו הציפיות שגם ישראל תעלה אותה, התעורר דיון בשאלה אם יש להחזיר את המרווח המחייב ל-6 נקודות בסיס, ± 3 . הוועדה הסכימה כי כיום אין צורך לשנות את המרווח המצומצם.

2. החטיבה למידע ולסטטיסטיקה (מו"ס) בבנק ישראל סיימה את הפרויקט להעמקת הסטטיסטיקה, ובמסגרת זו התווספו כחמישים בנקים זרים שמדווחים על פעילותם בנגזרי התלבור. כיוון שטיוב הנתונים לא הסתיים ניתן לקבל רק מושג ראשוני לגבי היקפה הכולל של הפעילות. רועי שטיין הציג לוחות שמראים כי להוציא את נגזרי ה-OIS, היקף הפעילות בנגזרים גדול מאוד בקרב המוסדות הפיננסיים הזרים.

3. חטיבת מו"ס מפרסמת באתר האינטרנט של בנק ישראל את לוח העסקאות שביצעו הבנקים התורמים. נציגי הבנקים התורמים ביקשו להוסיף גם את לוח העסקאות שביצעו כלל המדווחים, לאחר שיושלם טיוב הנתונים. הבקשה הועברה לחטיבת מו"ס ובכוונתה להציג את הנתונים על סך העסקאות לכשיושלם הטיוב.

4. נציגי הבנקים מסרו לחטיבת מו"ס דיווחים על העסקאות שביצעו ב-2018, והם התבקשו לוודא כי הדיווחים על עסקאותיהם בחו"זי ה-OIS וה-FRA תואמים לעסקאותיהם בפועל.

ההחלטות שהתקבלו בפגישה זו:

5. לא התקבלו החלטות בפגישה זו.