

הוראות בנק ישראל (נכסים נזילים) (תיקון), התשע"א-2011

בתוקף סמכותי לפי סעיף 38(ב) לחוק בנק ישראל, התש"ע-2010,¹ אני מורה לאמור:

הוספת פרק רביעי 1. אחרי סעיף 20 להוראות בנק ישראל (נכסים נזילים), התשל"א-1971,² יבוא:

"פרק רביעי 1: נזילות על עסקות החלף ועסקות המרה עתידית

הגדרות 20א. בפרק זה -

"הרכיב הארוך" בעסקת החלף – המועד האחרון

במהלך חיי העסקה שבו נעשית המרה בין

המטבעות הנקובים בעסקה;

"הרכיב הקצר" בעסקת החלף – המועד הראשון

במהלך חיי העסקה שבו נעשית המרה בין

המטבעות הנקובים בעסקה;

"יום מסחר במטבע חוץ" - יום שבו מפרסם בנק

ישראל שער יציג;

"עסקת החלף" – עסקה המכונה FX Swap או

Currency Swap של המרת מטבע ישראלי

במטבע חוץ או מטבע חוץ במטבע ישראלי

(הרכיב הקצר) במקביל להתחייבות לבצע

בעתיד בתאריך או בתאריכים נקובים

מראש המרה של מטבע החוץ במטבע

הישראלי או של המטבע הישראלי במטבע

החוץ, בהתאמה (הרכיב הארוך), וזאת

בתנאים הנקובים מראש בהתחייבות;

¹ ס"ח התש"ע, עמ' 452.

² ק"ת התשל"א, עמ' 690; התשנ"ח, עמ' 209.

”עסקת המרה עתידית” – עסקה המכונה עסקת Forward שלפיה מתחייב צד לעסקה למסור בעתיד לצד אחר לעסקה מטבע ישראלי כנגד מטבע חוץ או מטבע חוץ כנגד מטבע ישראלי, או את ההפרש בין שער החליפין בין המטבעות במועד קשירת העסקה לבין שער החליפין בין המטבעות במועד העתידי הנקוב בהתחייבות, וזאת במועד קבוע מראש שהוא לפחות שלושה ימי מסחר במטבע חוץ לפני המועד העתידי הנקוב בהתחייבות או במועד שייקבע בין הצדדים לעסקה, והכל - בסכום ובתנאים הנקובים מראש בהתחייבות;

”תושב חוץ” - מי שאינו תושב ישראל;

”תושב ישראלי” - כל אחד מאלה:

- (1) אזרח ישראלי, או מי שנמצא בישראל או באזור יהודה ושומרון (בהגדרה זו – אזור) על פי אשרת עולה או תעודת עולה, או על פי רשיון לישיבת קבע, ובלבד שבשנים עשר החודשים שקדמו לביצוע עסקה שהה בישראל או באזור תקופה העולה על 180 ימים, ברציפות או לסירוגין;
- (2) תאגיד שהואגד בישראל או באזור.

נזילות חובה על עסקת החלף 20.ב. תאגיד בנקאי חייב להחזיק נכסים נזילים במטבע ישראלי בשיעור של 10 אחוזים, כנגד המטבע הישראלי שנתן לתושב חוץ או שקיבל מתושב חוץ במסגרת הרכיב הקצר של עסקת החלף, וזאת מיום הקשירה של עסקת החלף.

נזילות חובה על עסקת המרה עתידית 20.ג. תאגיד בנקאי חייב להחזיק נכסים נזילים במטבע ישראלי בשיעור של 10 אחוזים, על התחייבותו כלפי תושב חוץ לתת או לקבל מטבע ישראלי כנגד מטבע חוץ, במסגרת עסקת המרה עתידית, וזאת מיום הקשירה של עסקת המרה העתידית.”

תחילה ותחולה 2. תחילתן של הוראות אלה ביום כ"ב בשבט התשע"א (27 בינואר 2011) (להלן – יום התחילה), והן יחולו על עסקות החלף ועסקאות המרה עתידית שנקשרו מיום התחילה ואילך; לעניין זה, דין עסקה כאמור שהוארכה או חודשה ביום התחילה או לאחריו, כדין עסקה שנקשרה ביום התחילה או לאחריו.

התשע"א

) (2011

(חמ 106-3 ת 1-1)

סטנלי פישר
נגיד בנק ישראל