



איגוד מנהלי קרנות להשקעות בנאמנות (ע"ר)

08 בפברואר 2021

לכבוד

עו"ד אבי לאור, סגן מנהלת היחידה לפיקוח על קרנות נאמנות  
אבי ורשביאק, ראש תחום ניהול סיכונים, היחידה לפיקוח על קרנות נאמנות

מחלקת השקעות

רשות ניירות ערך

ירושלים 9546434

בדוא"ל

שלום רב,

**הנדון: הוראה למנהלי קרנות נאמנות והנאמנים בדבר כללים לביצוע עסקאות בנגזרי OTC –**

**מודל מקובל לשערוך זכויות והתחייבויות על פי חוזה אקדמה – עדכון**

**הוראת חישוב דמי ניהול משתנים בקרן מחקה – מודל מקובל לחישוב גובה הפרשי ריביות בין**

**מטבעות של עסקת פרוורד**

בשם חברי איגוד מנהלי קרנות להשקעות בנאמנות (ע"ר) (להלן: "האיגוד"), ובהמשך לדרך המקובלת לשערוך זכויות והתחייבויות על פי חוזה אקדמה ולחישוב גובה הפרשי ריבית בעסקת פרוורד שפורסמה באתר רשות ניירות ערך, אני מבקש להביא בפניכם הצעה לתיקון המודל בדבר שערוך זכויות והתחייבויות על פי חוזה אקדמה באופן שנספחים א' וב' יכללו גם התייחסות לצמד המטבעות דולר-רנמינבי סיני.

ההצעה האמורה תובא להלן במסגרת נספחים א' וב' שבהמשך מסמך זה, ועל מנת לשמור על מסמך מאוחד שמציג את הדרך המקובלת בכללותה, תשולב בתוך הדרך האמורה כפי שהוגשה לרשות בעבר.

### **מודל זכויות והתחייבויות**

1. סעיף 5.2 להוראת דמי ניהול משתנים קובע כי שווי זכויות והתחייבויות על פי חוזה אקדמה יחושב בדרך המקובלת לחישובו.
2. כזכור, האיגוד נתבקש על ידי הרשות לתת התייחסותו בדבר מודל מקובל לקביעת שווי זכויות והתחייבויות כאמור.
3. שווי הוגן של חוזה אקדמה יחושב לפי מתודולוגיה של היוון תזרימים עתידיים, באופן שיביא לידי ביטוי את עקומי הריבית בשוק. נתוני השוק יילקחו ממערכת מידע מוכרת.
4. מוצע לשערך חוזה אקדמה לפי הנוסחה הבאה:

$$Value_t = \frac{N \cdot (F_t^T - F_0^T)}{1 + r_t^T(C) \cdot t_c}$$

כאשר:

Value <sub>t</sub>	שערון נוכחי של חוזה האקדמה במטבע המשני (המטבע המוביל).
N	הערך הנקוב של חוזה האקדמה במטבע הראשי (המטבע המוביל).
F <sub>T<sub>t</sub></sub>	שער הפורוורד ליום השערון, קרי: שער הספוט ליום השערון (כפי שהוא נלקח בחישוב שווי נכסי הקרן) בתוספת נקודות הפורוורד של חוזה אקדמה חדש למועד פקיעה זהה.
F <sub>T<sub>0</sub></sub>	שער הפורוורד בחוזה האקדמה המקורי שמבוקש לשערך.
r <sub>T<sub>t</sub></sub> (c)	הריבית להיוון של המטבע המשני (המטבע המוביל), במונחים שנתיים.
t <sub>c</sub>	מספר ימים לתום העיסקה לחלק למספר הימים בשנה המייצג את אותו מטבע (360 או 365, לפי העניין).

לצורך האמור לעיל:

1. נקודות הפורוורד של חוזה אקדמה חדש למועד פקיעה זהה תילקחנה בהתאם למחירי אמצע בשוק (MID) כפי שהם מצוטטים בטיקרים ובנוסחה המפורטת בנספח א' המצ"ב למכתב זה. ביחס לחוזה אקדמה בין השקל לבין אחד מהמטבעות המנויים בנספח א', שלגביו לא ניתן טיקר בנספח א', המחיר של חוזה האקדמה כאמור יילקח לפי הנוסחה היעודית המצויינת בנספח ג'.
  2. לצורכי פשטות ואחידות, מוצע כי הריבית להיוון של המטבע המשני תהיה הריבית הבינבנקאית ליתרת תקופת חוזה האקדמה, כמצוטט בטיקרים שבנספח ב' המצ"ב למכתב זה.
  3. לצורך אחידות, כל המנהלים יעשו שימוש באותם טיקרים ובאותן נוסחאות המפורטים בנספחים א', ב' וג', לפי הענין. מקום בו יחולו שינויים בטיקרים ו/או בנוסחאות בעתיד, או יתווספו טיקרים, האיגוד, לאחר קבלת אישור רשות ני"ע, יעדכן בהתאמה את נספחים א', ב' וג' האמורים.
  5. לצורך חישוב הריבית להיוון של המטבע המשני ו/או נקודות הפורוורד בין שתי תקופות יש לבצע אינטרפולציה בין 2 נקודות סמוכות מבין אלה שנמצאות בנספח א' או ב' האמורים לעיל, ובנוסף להגדיר מספר ימים מדויק לכל טיקר. בנספח א' נכללת הנוסחה למשיכת מספר הימים שנכלל בטיקר של הפורוורד.
- מקום בו לא קיימת ריבית להיוון של המטבע המשני לתקופה של יום אחד, והריבית להיוון של המטבע המשני הקרובה ביותר היא ריבית לשבוע, הריבית ליום אחד תקבל את הערך של הריבית לשבוע.

כמו כן, מלבד בעסקאות ספוט שהסליקה שלהן מבוצעת במועד של עד T+2, מקום בו לא קיימות נקודות של המטבע הראשי לתקופה פחותה משבוע, הנקודות לתקופה של עד שבוע תחושבנה על פי נוסחת האינטרפולציה, כאשר R1 ו-D1 יקבלו את הערך 0.

**נוסחת אינטרפולציה לינארית - מציאת ריבית בין שתי תקופות**

$$R2 = [(R3 - R1) * ((D2 - D1) / (D3 - D1))] + R1$$

R – ריבית או נקודות פרוורוד, לפי הענין –

D – ימים

דוגמה: נניח כי ביום 31/10/2018 נקודות הפרוורוד של דולר-שקל לחודש הינן מינוס 90.49 שמחושב לפי תקופה של 30 יום, ונקודות הפרוורוד של דולר-שקל לחודשיים הינן מינוס 177.75 שמחושב לפי תקופה של 61 יום. לצורך חישוב ביום 31/10/2018 של נקודות פרוורוד של חוזה אקדמה על דולר ארה"ב שמסתיים בעוד 40 ימים, R1 יהיה מינוס 90.49, D1 יהיה 30, R3 יהיה מינוס 177.75, D3 יהיה 61 יום ו-D2 יהיה 40.

6. כמו כן, כיוון שמדובר בעסקאות עד שנה, אין צורך לבצע חישובי ריבית-דריבית וניתן להשתמש בריבית הרגילה. למען הסר ספק מובהר כי האיגוד יפנה לרשות ני"ע לקבלת אישור, בכל אחד מהמקרים הבאים: א. שינוי בטיקרים המפורטים בנספחים א' ו/או ב', ב. הוספת טיקרים נוספים לנספחים א' ו/או ב', ג. בקשה לשימוש בנוסחא היעודית שבנספח ג' ביחס למטבע חדש שאינו אחד מהמטבעות המנוי בנספח א'.
  7. להערכת האיגוד המסכים המפורטים בנספח א' מכסים למעלה מ-90% מהיקף עסקאות האקדמה ולמיטב ידיעת האיגוד המודל ניתן לישום ללא עלויות חריגות. נספח ג' נדרש רק לחלק לא מהותי מעסקאות האקדמה (עסקאות שאינן במטבעות המובילים).
  8. במהלך הרבעון הרביעי 2019 האיגוד יבחן ויצגי לרשות ני"ע בדיקות שביצע לתקפות השימוש במודל והיקף השימוש והצורך בנספח ג'.
  9. מבלי לגרוע מהאמור, יובהר, כי מקום בו, עבור אחד הטיקרים האמורים, לא מוצג מידע במערכת המידע הרלוונטית עבור יום השערוד, לא ילקח בחשבון הטיקר האמור לעניין חישוב האינטרפולציה, והחישוב יבוצע לפי הריביות הסמוכות המציגות מידע.
- דוגמה: אם עבור ריבית ליש"ט קיימים שני טיקרים שאין עבורם נתונים לצורך חישוב הריבית עבור ארבעה חודשים, יש להסתמך על הריבית עבור שלושה חודשים ועבור שישה חודשים.

## מודל הפרשי ריביות

10. במסגרת נספח א' להוראת דמי ניהול משתנים נקבע כי גובה הפרשי הריביות בין המטבעות של עסקת הפורוורד, כשהוא מבוטא בנקודות (הנדרש לצורך חישוב ערך נכס המעקב בקרן מנוטרלת מטבע), יחושב בהתאם למודל מקובל שיאושר על ידי הנאמן והרשות – ר' הגדרת FP להלן:

### נספח א'

ערך נכס המעקב בקרן מנוטרלת מטבע יחושב בהתאם לנוסחה הבאה:

$$M_t = M^* \times R_t \times Q_t$$

כאשר:

"M<sup>\*</sup>" - ערך נכס המעקב, כפי שפורסם על ידי מי שעורך אותו ביום t.  
 "R<sub>t</sub>" - מקדם המבטא היחס בין שיעורי ריביות ליום t, בהתאם לנוסחה הבאה:

$$R_t = R_{t-1} \times r(t)$$

כאשר:

$$r(t) = 1 + (FP/Div/Fx/Days)$$

כאשר:

$$R_1 = 1$$

"FP" - גובה הפרשי הריביות בין המטבעות של עסקת הפורוורד, כשהוא מבוטא בנקודות, חישוב הנתון ייעשה בהתאם למודל מקובל שיאושר על ידי הנאמן והרשות.  
 "Div" - תרגום של נקודות הפורוורד לשווי כספי במטבע המובל.  
 "FX" - שער השערך העדכני של המטבע המובל.  
 "Days" - מספר הימים בפועל לפקיעה של הפורוורד המייצג שעבורו נלקחים כל הפרמטרים ממערכת המידע כאמור.  
 הפרמטרים בנוסחה יילקחו לפי מחירי שוק במערכת מידע בינלאומית של עסקת פורוורד ל-3 חודשים.

11. הרשות ציינה בפני האיגוד כי מודל מקובל כאמור נדרש מכיוון שחל קושי בחישוב הפרשי ריביות עבור מטבעות שאין מידע בדבר עסקאות פורוורד לגביהם.

12. כזכור, האיגוד נתבקש על ידי הרשות לתת התייחסותו בדבר מודל מקובל כאמור.

13. בהתאם לאמור ולהצעת הרשות, מוצע כי גובה הפרשי הריביות בין המטבעות של עסקת הפורוורד, כשהוא מבוטא בנקודות (FP), יחושב לפי נקודות הפורוורד שנלקחות לפי לצורך שערך חוזה אקדמה ל-3 חודשים בין צמד המטבעות של עסקת הפורוורד. בהתאם: א. ביחס להפרשי הריביות של השקל מול מטבע הדולר ארה"ב, האירו או הליש"ט, הם יחושבו לפי נקודות הפורוורד של חוזה אקדמה ל-3 חודשים בין צמד המטבעות של עסקת הפורוורד המפורט בנספח א'. ו- ב. ביחס להפרשי הריביות של השקל מול מטבע אחר שמנוי בנספח א' ושאינו הדולר ארה"ב, האירו או הליש"ט, הם יחושבו לפי נקודות הפורוורד של חוזה אקדמה ל-3 חודשים בין צמד המטבעות של עסקת הפורוורד לפי הנוסחה היעודית המפורטת בנספח ג'.

אנו עומדים לרשותכם בכל שאלה ו/או הבהרה נדרשת.

**בכבוד רב,**

**אלי בבלי, יו"ר**

**איגוד מנהלי קרנות להשקעות בנאמנות (ע"ר)**

העתק:

גבי שרון אופיר שטרית – מנהלת היחידה לפיקוח על קרנות נאמנות, מחלקת השקעות, רשות ניירות ערך ;  
עו"ד (רו"ח) איציק זקן – מנהל סיכונים ראשי, מחלקת השקעות, רשות ניירות ערך ;  
עו"ד מאיה גרטי-גלבווע, היועצת המשפטית של היחידה לפיקוח על קרנות נאמנות, מחלקת השקעות, רשות ניירות  
ערך ;  
חברי האיגוד.

## נספח א'

G	F	E	D	C	B	A	h
			נספחות לחשיבת נתונים מבלומברג (או מערכת אחרת עליה יוסכם)	טיקר בלומברג (או מערכת אחרת עליה יוסכם)		31/10/2018	1
		נספח לחישוב נקודות פרוורד	נספח לחישוב ימים	נקודות פרוורד של מטבע ראשי	תקופה		2
MID	DAYS_TO_MTY	MID	DAYS_TO_MTY				3
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C4,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C4,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	ILS1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר-שקל	4
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C5,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C5,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	ILS1M BGN CURRENCY	חודש		5
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C6,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C6,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	ILS2M BGN CURRENCY	חודשים 2		6
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C7,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C7,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	ILS3M BGN CURRENCY	חודשים 3		7
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C8,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C8,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	ILS6M BGN CURRENCY	חודשים 6		8
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C9,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C9,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	ILS9M BGN CURRENCY	חודשים 9		9
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C10,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C10,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	ILS12M BGN CURRENCY	שנה		10
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C11,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C11,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EURILS1W CMPL CURRENCY	שבוע	אירו- שקל	11
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C12,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C12,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EURILS1M CMPL CURRENCY	חודש		12
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C13,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C13,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EURILS2M CMPL CURRENCY	חודשים 2		13
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C14,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C14,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EURILS3M CMPL CURRENCY	חודשים 3		14
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C15,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C15,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EURILS6M CMPL CURRENCY	חודשים 6		15
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C16,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C16,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EURILS9M CMPL CURRENCY	חודשים 9		16
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C17,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C17,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EURILS12M CMPL CURRENCY	שנה		17
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C18,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C18,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS1W CMPL CURRENCY	שבוע	לי"ט - שקל	18
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C19,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C19,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS1M CMPL CURRENCY	חודש		19
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C20,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C20,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS2M CMPL CURRENCY	חודשים 2		20
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C21,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C21,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS3M CMPL CURRENCY	חודשים 3		21
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C22,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C22,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS4M CMPL CURRENCY	חודשים 4		22
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C23,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C23,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS5M CMPL CURRENCY	חודשים 5		23
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C24,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C24,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS6M CMPL CURRENCY	חודשים 6		24
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C25,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C25,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS9M CMPL CURRENCY	חודשים 9		25
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C26,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C26,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	GBPILS12M CMPL CURRENCY	שנה		26
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C27,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C27,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר יפן יפני	27
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C28,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C28,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY2W BGN CURRENCY	שבועות 2		28
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C29,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C29,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY3W BGN CURRENCY	שבועות 3		29
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C30,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C30,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY1M BGN CURRENCY	חודש		30
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C31,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C31,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY2M BGN CURRENCY	חודשים 2		31
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C32,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C32,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY3M BGN CURRENCY	חודשים 3		32
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C33,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C33,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY4M BGN CURRENCY	חודשים 4		33
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C34,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C34,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY5M BGN CURRENCY	חודשים 5		34
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C35,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C35,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY6M BGN CURRENCY	חודשים 6		35
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C36,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C36,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY9M BGN CURRENCY	חודשים 9		36
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C37,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C37,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	JPY12M BGN CURRENCY	שנה		37
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C38,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C38,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR1W BGN CURRENCY	שבוע	אירו-דולר	38
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C39,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C39,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR2W BGN CURRENCY	שבועות 2		39
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C40,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C40,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR3W BGN CURRENCY	שבועות 3		40
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C41,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C41,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR1M BGN CURRENCY	חודש		41
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C42,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C42,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR2M BGN CURRENCY	חודשים 2		42
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C43,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C43,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR3M BGN CURRENCY	חודשים 3		43
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C44,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C44,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR4M BGN CURRENCY	חודשים 4		44
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C45,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C45,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR5M BGN CURRENCY	חודשים 5		45
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C46,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C46,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR6M BGN CURRENCY	חודשים 6		46
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C47,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C47,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR9M BGN CURRENCY	חודשים 9		47
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C48,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C48,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	EUR12M BGN CURRENCY	שנה		48
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C49,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C49,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyyymmdd"))	IRN1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר- חפי	49

## נספח א' – המשך

G	F	E	D	C	B	A	
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C49,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C49,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר - חפי	49
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C50,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C50,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN1M BGN CURRENCY	חודש 1		50
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C51,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C51,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN2M BGN CURRENCY	חודשים 2		51
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C52,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C52,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN3M BGN CURRENCY	חודשים 3		52
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C53,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C53,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN6M BGN CURRENCY	חודשים 6		53
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C54,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C54,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN9M BGN CURRENCY	חודשים 9		54
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C55,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C55,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN12M BGN CURRENCY	שנה		55
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C56,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C56,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	BCN1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר-ראל ברזיל	56
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C57,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C57,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	BCN1M BGN CURRENCY	חודש		57
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C58,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C58,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	BCN2M BGN CURRENCY	חודשים 2		58
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C59,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C59,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	BCN3M BGN CURRENCY	חודשים 3		59
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C60,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C60,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	BCN6M BGN CURRENCY	חודשים 6		60
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C61,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C61,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	BCN9M BGN CURRENCY	חודשים 9		61
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C62,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C62,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	BCN12M BGN CURRENCY	שנה		62
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C63,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C63,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר - דולר הונג קונג	63
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C64,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C64,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD2W BGN CURRENCY	שבועות 2		64
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C65,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C65,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD3W BGN CURRENCY	שבועות 3		65
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C66,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C66,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD1M BGN CURRENCY	חודש		66
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C67,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C67,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD2M BGN CURRENCY	חודשים 2		67
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C68,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C68,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD3M BGN CURRENCY	חודשים 3		68
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C69,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C69,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD4M BGN CURRENCY	חודשים 4		69
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C70,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C70,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD5M BGN CURRENCY	חודשים 5		70
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C71,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C71,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD6M BGN CURRENCY	חודשים 6		71
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C72,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C72,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD9M BGN CURRENCY	חודשים 9		72
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C73,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C73,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	HKD12M BGN CURRENCY	שנה		73
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C74,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C74,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	KWN1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר-וונן קוראני	74
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C75,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C75,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	KWN1M BGN CURRENCY	חודש		75
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C76,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C76,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	KWN2M BGN CURRENCY	חודשים 2		76
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C77,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C77,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	KWN3M BGN CURRENCY	חודשים 3		77
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C78,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C78,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	KWN6M BGN CURRENCY	חודשים 6		78
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C79,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C79,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	KWN9M BGN CURRENCY	חודשים 9		79
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C80,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C80,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	KWN12M BGN CURRENCY	שנה		80
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C81,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C81,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	NTN1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר - דולר טיוון	81
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C82,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C82,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	NTN1M BGN CURRENCY	חודש		82
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C83,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C83,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	NTN2M BGN CURRENCY	חודשים 2		83
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C84,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C84,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	NTN3M BGN CURRENCY	חודשים 3		84
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C85,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C85,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	NTN6M BGN CURRENCY	חודשים 6		85
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C86,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C86,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	NTN9M BGN CURRENCY	חודשים 9		86
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C87,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C87,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	NTN12M BGN CURRENCY	שנה		87
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C88,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C88,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר אוסטרלי-דולר	88
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C89,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C89,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud2W BGN CURRENCY	שבועות 2		89
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C90,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C90,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud3W BGN CURRENCY	שבועות 3		90
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C91,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C91,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud1m BGN CURRENCY	חודש		91

## נספח א' – המשך

G	F	E	D	C	B	A	
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C91,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C91,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud1m BGN CURRENCY	חדש		91
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C92,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C92,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud2m BGN CURRENCY	חודשים 2		92
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C93,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C93,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud3m BGN CURRENCY	חודשים 3		93
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C94,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C94,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud4m BGN CURRENCY	חודשים 4		94
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C95,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C95,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud5m BGN CURRENCY	חודשים 5		95
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C96,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C96,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud6m BGN CURRENCY	חודשים 6		96
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C97,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C97,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud9m BGN CURRENCY	חודשים 9		97
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C98,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C98,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	aud12m BGN CURRENCY	שנה		98
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C99,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C99,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר-קנדי	99
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C100,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C100,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad2W BGN CURRENCY	שבועות 2		100
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C101,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C101,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad3W BGN CURRENCY	שבועות 3		101
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C102,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C102,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad1m BGN CURRENCY	חדש		102
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C103,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C103,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad2m BGN CURRENCY	חודשים 2		103
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C104,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C104,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad3m BGN CURRENCY	חודשים 3		104
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C105,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C105,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad4m BGN CURRENCY	חודשים 4		105
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C106,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C106,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad5m BGN CURRENCY	חודשים 5		106
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C107,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C107,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad6m BGN CURRENCY	חודשים 6		107
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C108,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C108,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad9m BGN CURRENCY	חודשים 9		108
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C109,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C109,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	cad12m BGN CURRENCY	שנה		109
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C110,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C110,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר-נתר שוודי	110
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C111,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C111,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek2W BGN CURRENCY	שבועות 2		111
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C112,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C112,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek3W BGN CURRENCY	שבועות 3		112
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C113,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C113,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek1m BGN CURRENCY	חדש		113
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C114,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C114,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek2m BGN CURRENCY	חודשים 2		114
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C115,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C115,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek3m BGN CURRENCY	חודשים 3		115
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C116,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C116,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek4m BGN CURRENCY	חודשים 4		116
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C117,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C117,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek5m BGN CURRENCY	חודשים 5		117
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C118,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C118,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek6m BGN CURRENCY	חודשים 6		118
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C119,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C119,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek9m BGN CURRENCY	חודשים 9		119
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C120,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C120,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sek12m BGN CURRENCY	שנה		120
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C121,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C121,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר-דולר סינגפור	121
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C122,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C122,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd2W BGN CURRENCY	שבועות 2		122
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C123,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C123,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd3W BGN CURRENCY	שבועות 3		123
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C124,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C124,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd1m BGN CURRENCY	חדש		124
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C125,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C125,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd2m BGN CURRENCY	חודשים 2		125
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C126,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C126,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd3m BGN CURRENCY	חודשים 3		126
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C127,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C127,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd4m BGN CURRENCY	חודשים 4		127
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C128,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C128,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd5m BGN CURRENCY	חודשים 5		128
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C129,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C129,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd6m BGN CURRENCY	חודשים 6		129
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C130,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C130,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd9m BGN CURRENCY	חודשים 9		130
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C131,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C131,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	sgd12m BGN CURRENCY	שנה		131
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C132,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C132,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	chf1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר-פרנק שווייטרי	132
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C133,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C133,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	chf2W BGN CURRENCY	שבועות 2		133



## נספח א' – המשך

G	F	E	D	C	B	A	
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C133,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C133,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF2W BGN CURRENCY	שבועות 2		133
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C134,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C134,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF3W BGN CURRENCY	שבועות 3		134
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C135,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C135,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF1m BGN CURRENCY	חודש		135
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C136,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C136,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF2m BGN CURRENCY	חודשים 2		136
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C137,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C137,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF3m BGN CURRENCY	חודשים 3		137
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C138,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C138,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF4m BGN CURRENCY	חודשים 4		138
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C139,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C139,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF5m BGN CURRENCY	חודשים 5		139
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C140,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C140,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF6m BGN CURRENCY	חודשים 6		140
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C141,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C141,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF9m BGN CURRENCY	חודשים 9		141
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C142,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C142,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CHF12m BGN CURRENCY	שנה		142
		BDH(\$C143,E\$2,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C143,D\$2,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CCN1W BGN CURRENCY	שבוע	דולר - רמניב' סיני	143
		BDH(\$C144,E\$2,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C144,D\$2,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CCN1M BGN CURRENCY	חודש		144
		BDH(\$C145,E\$2,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C145,D\$2,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CCN2M BGN CURRENCY	חודשים 2		145
		BDH(\$C146,E\$2,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C146,D\$2,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CCN3M BGN CURRENCY	חודשים 3		146
		BDH(\$C147,E\$2,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C147,D\$2,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CCN6M BGN CURRENCY	חודשים 6		147
		BDH(\$C148,E\$2,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C148,D\$2,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CCN9M BGN CURRENCY	חודשים 9		148
		BDH(\$C149,E\$2,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C149,D\$2,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	CCN12M BGN CURRENCY	חודשים 12		149

## נספח ב'

C	B	A	
טיקר לייבור			1
ריבית להיוון למטבע משני		צמד מטבעות (מטבע ראשי-מטבע משני)	2
TELBORON INDEX	יום	דולר-שקל	3
TELBOR01 INDEX	חודש		4
TELBOR03 INDEX	חודשים 3		5
TELBOR06 INDEX	חודשים 6		6
TELBOR09 INDEX	חודשים 9		7
TELBOR12 INDEX	שנה		8
TELBORON INDEX	יום	אירו-שקל	9
TELBOR01 INDEX	חודש		10
TELBOR03 INDEX	חודשים 3		11
TELBOR06 INDEX	חודשים 6		12
TELBOR09 INDEX	חודשים 9		13
TELBOR12 INDEX	שנה		14
TELBORON INDEX	יום	לי"שט - שקל	15
TELBOR01 INDEX	חודש		16
TELBOR03 INDEX	חודשים 3		17
TELBOR06 INDEX	חודשים 6		18
TELBOR09 INDEX	חודשים 9		19
TELBOR12 INDEX	שנה		20
JY0001W INDEX	שבוע	דולר-יין יפני	21
JY0001M INDEX	חודש		22
JY0002M INDEX	חודשים 2		23
JY0003M INDEX	חודשים 3		24
JY0006M INDEX	חודשים 6		25
JY0012M INDEX	שנה		26
US000/N Index	יום	אירו-דולר	27
US0001W Index	שבוע		28
US0001M Index	חודש		29
US0002M Index	חודשיים		30
US0003M Index	חודשים 3		31
US0006M Index	חודשים 6		32
US0012M Index	חודשים 12		33
IN000/N Index	יום	דולר-רופי	34
IN0014D INDEX	שבועיים		35
IN001M INDEX	חודש		36
IN003M INDEX	חודשים 3		37
BZDIOVRA Index	יום	דולר-ריאל בחיל	38
BCSFAPDV BLP Curncy	חודש		39
BCSFBDPV BLP Curncy	חודשיים		40
BCSFCDPV BLP Curncy	חודשים 3		41
BCSFDPDV BLP Curncy	חודשים 4		42
BCSFEPDV BLP Curncy	חודשים 5		43
BCSFFPDV BLP Curncy	חודשים 6		44
BCSFGPDV BLP Curncy	חודשים 7		45
BCSFHPDV BLP Curncy	חודשים 8		46
BCSFIPDV BLP Curncy	חודשים 9		47
BCSFJPDV BLP Curncy	חודשים 10		48
BCSFKPDV BLP Curncy	חודשים 11		49
BCSFLPDV BLP Curncy	חודשים 12		50
HIHDO/N Index	יום	דולר-דולר הונג קונג	51
HIHD1W INDEX	שבוע		52
HIHD2W INDEX	שבועות 2		53
HIHD01M INDEX	חודש		54
HIHD02M INDEX	חודשים 2		55

## נספח ב' - המשך

C	B	A	
HIHD02M INDEX	חודשים 2		55
HIHD03M INDEX	חודשים 3		56
HIHD06M INDEX	חודשים 6		57
HIHD12M INDEX	שנה		58
KRIB1W INDEX	שבוע	דולר-וואן קוריאני	59
KRBO1M Index	חודש		60
KRIB2M INDEX	חודשים 2		61
KRBO3M Index	חודשים 3		62
KRBO6M Index	חודשים 6		63
KRBO12M INDEX	שנה		64
TAIBOR1w index	שבוע	דולר - דולר טיוואן	65
TAIBOR2w index	שבועות 2		66
TDSF30D INDEX	חודש		67
TDSF60D INDEX	חודשים 2		68
TDSF90D INDEX	חודשים 3		69
TDSF120D INDEX	חודשים 4		70
TDSF150D INDEX	חודשים 5		71
TAIBOR6m index	חודשים 6		72
TAIBOR9m index	חודשים 9		73
TAIBOR1y index	שנה		74
cdor01 index	חודש	דולר - דולר קנדי	75
cdor02 index	חודשים 2		76
cdor03 index	חודשים 3		77
cdor06 index	חודשים 6		78
cdor12 index	חודשים 12		79
US000/N Index	יום	דולר אוסטרלי-דולר	80
US0001W Index	שבוע		81
US0001M Index	חודש		82
US0002M Index	חודשיים		83
US0003M Index	חודשים 3		84
US0006M Index	חודשים 6		85
US0012M Index	חודשים 12		86
sf000/N Index	יום	דולר - פרנק שווצרי	87
sf0001W Index	שבוע		88
sf0001M Index	חודש		89
sf0002M Index	חודשיים		90
sf0003M Index	חודשים 3		91
sf0006M Index	חודשים 6		92
sf0012M Index	חודשים 12		93
SDDR1T CURRENCY	יום	דולר - דולר סינגפור	94
SDDRIZ CURRENCY	שבוע		95
SDDRA CURRENCY	חודש		96
SDDRC CURRENCY	חודשים 3		97
SDDRF CURRENCY	חודשים 6		98
SDDRI CURRENCY	חודשים 9		99
SDDR1 CURRENCY	חודשים 12		100
SKDR1T Curncy	יום	דולר-קרוונה שבדית	101
SKDR1Z Curncy	שבוע		102
SKDRA Curncy	חודש		103
SKDRB Curncy	חודשים 2		104
SKDRC Curncy	חודשים 3		105
SKDRF Curncy	חודשים 6		106
SKDRI Curncy	חודשים 9		107
SKDR1 Curncy	חודשים 12		108

## נספח ב' – המשך

SHIFON INDEX	יום	דולר - רנמינבי סיני	109
SHIF1W INDEX	שבוע		110
SHIF2W INDEX	שבועות 2		111
SHIF1M INDEX	חודש		112
SHIF3M INDEX	חודשים 3		113
SHIF6M INDEX	חודשים 6		114
SHIF9M INDEX	חודשים 9		115
SHIF1Y INDEX	חודשים 12		116

## נספח ג'

A	
	1
נקודות פרוורד המגלמות פערי ריביות לצמדי מטבעות שיש להן BFIX	
"=BFxForward("USDILS",A6,"midpoints","ForwardSource=BFIX","spotSource=BFIX","HOLIDAYVALUES=TRUE","PRICINGDATE",A9)"	
	4
תאריך סיום העסקה	5
12/12/2018 (דוגמא)	6
	7
תאריך נכונות נקודות הפרוורד	8
17/08/2018 (דוגמא)	9
	10
	11
נקודות פרוורד המגלמות פערי ריביות לצמדי מטבעות ללא BFIX	
"=BFxForward("CADILS",A16,"midpoints","ForwardSource=BFIX","spotSource=BFIX","via=USD","HOLIDAYVALUES=TRUE","PRICINGDATE",A19)"	
	14
תאריך סיום העסקה	15
12/12/2018 (דוגמא)	16
	17
תאריך נכונות נקודות הפרוורד	18
17/08/2018 (דוגמא)	19