



איגוד מנהלי קרנות להשקעות בנאמנות (ע"ר)

15 אוגוסט 2024

לכבוד

עו"ד איל פלם, סגן מנהל יחידת רישוי ופיקוח על מוצרים פיננסיים

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**

**הוראת חישוב דמי ניהול משתנים בקרן מחקה – מודל מקובל לחישוב גובה הפרשי ריביות בין מטבעות של עסקת פורוורד – עדכון**

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 פורוורד שגובשה מול רשות ניירות ערך, אני מבקש להביא בפניך הצעה לעדכון טיקרים, הכלולים בנספח ב' להלן ומשמשים לצורך האמור, עבור דולר קנדי, וזאת חלף הטיקרים הקיימים, וכן להוספת טיקרים למטבעות נוספים בנספח האמור (נוספו טבלאות עבור מטבעות מובלים נוספים, ללא תלות במטבע המוביל).

ההצעה האמורה תובא כאמור במסגרת נספח ב' 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>	שערוך נוכחי של חוזה האקדמה במטבע המשני (המטבע המובל).
N	הערך הנקוב של חוזה האקדמה במטבע הראשי (המטבע המובל).
F <sub>t</sub> <sup>T</sup>	שער הפורוורד ליום השערוך, קרי: שער הספוט ליום השערוך (כפי שהוא נלקח בחישוב שווי נכסי הקרן) בתוספת נקודות הפורוורד של חוזה אקדמה חדש למועד פקיעה זהה.
F <sub>0</sub> <sup>T</sup>	שער הפורוורד בחוזה האקדמה המקורי שמבוקש לשערך.
r <sub>t</sub> <sup>T(c)</sup>	הריבית להיוון של המטבע המשני (המטבע המובל), 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 הבינקאית 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 פרוורד, לפי הענין

D – ימים

דוגמה: נניח כי ביום 31/10/2018 נקודות הפרוורד של דולר-שקל לחודש הינן מינוס 90.49 שמחושב לפי תקופה של 30 יום, ונקודות הפרוורד של דולר-שקל לחודשיים הינן מינוס 177.75 שמחושב לפי תקופה של 61 יום. לצורך חישוב ביום 31/10/2018 של נקודות פרוורד 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 ויצג 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 השערוך, 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:

" $M'_t$ " – ערך נכס המעקב, כפי שפורסם על ידי מי שעורך אותו ביום  $t$ .  
 " $R_t$ " – 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 בנוסחא 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 הנוסחא 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:

מר אבי לאור – מנהל יחידת רישוי ופיקוח על מוצרים פיננסיים, מחלקת השקעות, רשות ניירות

ערך;

חברי האיגוד.

## נספח א'

G	F	E	D	C	B	A	h
			נספח לחשיכת נתונים מבלומברג (או מערכת אחרת עליה יוסכס)	טיקר בלומברג (או מערכת אחרת עליה יוסכס)	תקופה	31/10/2018	1
		נספח לחשיכת נקודות פורורד	נספח לחשיכת נקודות פורורד	נקודות פורורד של מטבע ראשי	שכונות	דולר-שקל	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,"yyyymmdd"))	ILS1W BGN CURRENCY	שכונות		4
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C5,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C5,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	ILS1M BGN CURRENCY	חודש		5
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C6,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C6,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	ILS12M BGN CURRENCY	שנה		10
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C11,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C11,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	EURILS1W CMPL CURRENCY	שכונות	אירו-שקל	11
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C12,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C12,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	EURILS1M CMPL CURRENCY	חודש		12
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C13,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C13,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	EURILS12M CMPL CURRENCY	שנה		17
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C18,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C18,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	GBPILS1W CMPL CURRENCY	שכונות	ל"ש - שקל	18
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C19,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C19,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	GBPILS1M CMPL CURRENCY	חודש		19
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C20,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C20,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	GBPILS12M CMPL CURRENCY	שנה		26
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C27,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C27,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	JPY1W BGN CURRENCY	שכונות	דולר-י"ן יפני	27
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C28,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C28,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	JPY1M BGN CURRENCY	חודש		30
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C31,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C31,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	JPY12M BGN CURRENCY	שנה		37
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C38,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C38,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	EUR1W BGN CURRENCY	שכונות	אירו-דולר	38
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C39,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C39,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	EUR1M BGN CURRENCY	חודש		41
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C42,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C42,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	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,"yyyymmdd"))	EUR12M BGN CURRENCY	שנה		48
#NAME?	#NAME?	BDH(\$C49,E\$3,\$A\$1,\$A\$1)	BDP(\$C49,D\$3,"REFERENCE_DATE",TEXT(\$A\$1,"yyyymmdd"))	IRN1W BGN CURRENCY	שכונות	דולר- חפ"י	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-וון 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 טיוואן	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	חודש		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	חודש		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-כתר 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	חודש		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-סונגפור	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	חודש		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 שוויצרי	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 - רומניאני 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		
ריבית להיוון למטבע משני		צמד מטבעות (מטבע ראשי-מטבע משני)
TELBORON INDEX	יום	דולר-שקל
TELBOR01 INDEX	חודש	
TELBOR03 INDEX	חודשים 3	
TELBOR06 INDEX	חודשים 6	
TELBOR09 INDEX	חודשים 9	
TELBOR12 INDEX	שנה	
TELBORON INDEX	יום	אירו-שקל
TELBOR01 INDEX	חודש	
TELBOR03 INDEX	חודשים 3	
TELBOR06 INDEX	חודשים 6	
TELBOR09 INDEX	חודשים 9	
TELBOR12 INDEX	שנה	
TELBORON INDEX	יום	לי"ש - שקל
TELBOR01 INDEX	חודש	
TELBOR03 INDEX	חודשים 3	
TELBOR06 INDEX	חודשים 6	
TELBOR09 INDEX	חודשים 9	
TELBOR12 INDEX	שנה	

MUTKCALM INDEX	יום	דולר-יין יפני
JYSO1Z BGN CURRENCY	שבוע	
JYSO2Z BGN CURRENCY	שבועיים	
JYSOA BGN CURRENCY	חודש	
JYSOB BGN CURRENCY	חודשיים	
JYSOC BGN CURRENCY	חודשים 3	
JYSOD BGN CURRENCY	חודשים 4	
JYSOE BGN CURRENCY	חודשים 5	
JYSOF BGN CURRENCY	חודשים 6	
JYSOG BGN CURRENCY	חודשים 7	
JYSOH BGN CURRENCY	חודשים 8	
JYSOI BGN CURRENCY	חודשים 9	
JYSOJ BGN CURRENCY	חודשים 10	
JYSOK BGN CURRENCY	חודשים 11	
JYSO1 BGN CURRENCY	חודשים 12	
SOFRRATE INDEX	יום	איח-דולר
USOSFR1Z BGN CURRENCY	שבוע	
USOSFR2Z BGN CURRENCY	שבועיים	
USOSFRA BGN CURRENCY	חודש	
USOSFRB BGN CURRENCY	חודשיים	
USOSFRC BGN CURRENCY	חודשים 3	
USOSFRD BGN CURRENCY	חודשים 4	
USOSFRE BGN CURRENCY	חודשים 5	
USOSFRF BGN CURRENCY	חודשים 6	
USOSFRG BGN CURRENCY	חודשים 7	
USOSFRH BGN CURRENCY	חודשים 8	
USOSFRI BGN CURRENCY	חודשים 9	
USOSFRJ BGN CURRENCY	חודשים 10	
USOSFRK BGN CURRENCY	חודשים 11	
USOSFR1 BGN CURRENCY	חודשים 12	

## נספח ב' – המשך

IN000/N Index	יום	דולר- חפי
IN0014D INDEX	שבועיים	
IN001M INDEX	חודש	
IN003M INDEX	חודשים 3	
BZDIOVRA Index	יום	דולר-ריאל ברזיל
BCSFAPDV BLP Curncy	חודש	
BCSFBPDV BLP Curncy	חודשיים	
BCSFCPDV BLP Curncy	חודשים 3	
BCSFDPDV BLP Curncy	חודשים 4	
BCSFEPDV BLP Curncy	חודשים 5	
BCSFFPDV BLP Curncy	חודשים 6	
BCSFGPDV BLP Curncy	חודשים 7	
BCSFHPDV BLP Curncy	חודשים 8	
BCSFIPDV BLP Curncy	חודשים 9	
BCSFJPDV BLP Curncy	חודשים 10	
BCSFKPDV BLP Curncy	חודשים 11	
BCSFLPDV BLP Curncy	חודשים 12	

HIHDO/N Index	יום	דולר- דולר הונג קונג
HIHD1W INDEX	שבוע	
HIHD2W INDEX	שבועות 2	
HIHD01M INDEX	חודש	
HIHD02M INDEX	חודשים 2	
HIHD03M INDEX	חודשים 3	
HIHD06M INDEX	חודשים 6	
HIHD12M INDEX	שנה	
KRIB1W INDEX	שבוע	דולר-וואן קוריאני
KRBO1M Index	חודש	
KRIB2M INDEX	חודשים 2	
KRBO3M Index	חודשים 3	
KRBO6M Index	חודשים 6	
KRBO12M INDEX	שנה	
TAIBOR1w index	שבוע	דולר - דולר טיוואן
TAIBOR2w index	שבועות 2	
TDSF30D INDEX	חודש	
TDSF60D INDEX	חודשים 2	
TDSF90D INDEX	חודשים 3	
TDSF120D INDEX	חודשים 4	
TDSF150D INDEX	חודשים 5	
TAIBOR6m index	חודשים 6	
TAIBOR9m index	חודשים 9	
TAIBOR1y index	שנה	

CAONREPO Index	יום	דולר - דולר קנדי
CDSO1Z BGN Curncy	שבוע	
CDSO 2Z BGN Curncy	שבועות 2	
CDSOA BGN Curncy	חודש	
CDSOB BGN Curncy	חודשים 2	
CDSOC BGN Curncy	חודשים 3	
CDSOD BGN Curncy	חודשים 4	
CDSOE BGN Curncy	חודשים 5	
CDSOF BGN Curncy	חודשים 6	
CDSOI BGN Curncy	חודשים 9	
CDSO1 BGN Curncy	שנה	

## נספח ב' – המשך

SOFRRATE INDEX	יום	דולר אוסטרלי-דולר
USOSFR1Z BGN CURRENCY	שבוע	
USOSFR2Z BGN CURRENCY	שבועיים	
USOSFRA BGN CURRENCY	חודש	
USOSFRB BGN CURRENCY	חודשיים	
USOSFRC BGN CURRENCY	חודשים 3	
USOSFRD BGN CURRENCY	חודשים 4	
USOSFRE BGN CURRENCY	חודשים 5	
USOSFRF BGN CURRENCY	חודשים 6	
USOSFRG BGN CURRENCY	חודשים 7	
USOSFRH BGN CURRENCY	חודשים 8	
USOSFRI BGN CURRENCY	חודשים 9	
USOSFRJ BGN CURRENCY	חודשים 10	
USOSFRK BGN CURRENCY	חודשים 11	
USOSFR1 BGN CURRENCY	חודשים 12	
SRFXON3 INDEX	יום	דולר-פרנק שוויצרי
SFSNT1Z BGN CURRENCY	שבוע	
SFSNT2Z BGN CURRENCY	שבועיים	
SFSNTA BGN CURRENCY	חודש	
SFSNTB BGN CURRENCY	חודשיים	
SFSNTC BGN CURRENCY	חודשים 3	
SFSNTD BGN CURRENCY	חודשים 4	
SFSNTE BGN CURRENCY	חודשים 5	
SFSNTF BGN CURRENCY	חודשים 6	
SFSNTG BGN CURRENCY	חודשים 7	
SFSNTH BGN CURRENCY	חודשים 8	
SFSNTI BGN CURRENCY	חודשים 9	
SFSNTJ BGN CURRENCY	חודשים 10	
SFSNTK BGN CURRENCY	חודשים 11	
SFSNT1 BGN CURRENCY	חודשים 12	

## נספח ב' – המשך

SDDR1T CURRENCY	יום	דולר-דולר סינגפור
SDDRIZ CURRENCY	שבוע	
SDDRA CURRENCY	חודש	
SDDRC CURRENCY	חודשים 3	
SDDRF CURRENCY	חודשים 6	
SDDRI CURRENCY	חודשים 9	
SDDR1 CURRENCY	חודשים 12	

SKDR1T Curncy	יום	דולר-קרוונה שבדית
SKDR1Z Curncy	שבוע	
SKDRA Curncy	חודש	
SKDRB Curncy	חודשים 2	
SKDRC Curncy	חודשים 3	
SKDRF Curncy	חודשים 6	
SKDRI Curncy	חודשים 9	
SKDR1 Curncy	חודשים 12	
SHIFON INDEX	יום	דולר - רנמינבי סיני
SHIF1W INDEX	שבוע	
SHIF2W INDEX	שבועות 2	
SHIF1M INDEX	חודש	
SHIF3M INDEX	חודשים 3	
SHIF6M INDEX	חודשים 6	
SHIF9M INDEX	חודשים 9	
SHIF1Y INDEX	חודשים 12	

מבלי לגרוע מהאמור לעיל, להלן טבלאות עבור מטבעות מובלים נוספים, ללא תלות במטבע המוביל:

EUDR1T BGN Curncy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל אירו EUR
EUDR1Z BGN Curncy	שבוע 1	
EUDR2Z BGN Curncy	שבוע 2	
EUDRA BGN Curncy	חודש 1	
EUDRB BGN Curncy	חודש 2	
EUDRC BGN Curncy	חודש 3	
EUDRD BGN Curncy	חודש 4	
EUDRE BGN Curncy	חודש 5	
EUDRF BGN Curncy	חודש 6	
EUDRI BGN Curncy	חודש 9	
EUDR1 BGN Curncy	שנה	ריבית להיוון מטבע מובל לירה שטרלינג (פאונד) GBP
BPDR1T BGN Curncy	יום	
BPDR1Z BGN Curncy	שבוע 1	
BPDR2Z BGN Curncy	שבוע 2	
BPDR3Z BGN Curncy	שבוע 3	
BPDRA BGN Curncy	חודש 1	
BPDRB BGN Curncy	חודש 2	
BPDRC BGN Curncy	חודש 3	
BPDRF BGN Curncy	חודש 6	
BPDRI BGN Curncy	חודש 9	
BPDR1 BGN Curncy	שנה	



ADDR1T BGN Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל דולר אוסטרלי AUD
ADDR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
ADDR2Z BGN Cumcy	שבוע 2	
ADDR3Z BGN Cumcy	שבוע 3	
ADDRA BGN Cumcy	חודש 1	
ADDRB BGN Cumcy	חודש 2	
ADDRC BGN Cumcy	חודש 3	
ADDRD BGN Cumcy	חודש 4	
ADDRE BGN Cumcy	חודש 5	
ADDRF BGN Cumcy	חודש 6	
ADDRG BGN Cumcy	חודש 7	
ADDRH BGN Cumcy	חודש 8	
ADDRI BGN Cumcy	חודש 9	
ADDRJ BGN Cumcy	חודש 10	
ADDRK BGN Cumcy	חודש 11	
ADDR1 BGN Cumcy	שנה	

NKDR1T BGN Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל כתר נורבגי NOK
NKDR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
NKDR2W BGN Cumcy	שבוע 2	
NKDRA BGN Cumcy	חודש 1	
NKDRB BGN Cumcy	חודש 2	
NKDRC BGN Cumcy	חודש 3	
NKDRF BGN Cumcy	חודש 6	
NKDRI BGN Cumcy	חודש 9	
NKDR1 BGN Cumcy	שנה	
NDDR1T BGN Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל דולר ניו-זילנדי NZD
NDDR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
NDDR2Z BGN Cumcy	שבוע 2	
NDDRA BGN Cumcy	חודש 1	
NDDRB BGN Cumcy	חודש 2	
NDDRC BGN Cumcy	חודש 3	
NDDRD BGN Cumcy	חודש 4	
NDDRE BGN Cumcy	חודש 5	
NDDRF BGN Cumcy	חודש 6	
NDDRG BGN Cumcy	חודש 7	
NDDRH BGN Cumcy	חודש 8	
NDDRI BGN Cumcy	חודש 9	
NDDRJ BGN Cumcy	חודש 10	
NDDRK BGN Cumcy	חודש 11	
NDDR1 BGN Cumcy	שנה	

PZDR1T Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל זלוטי פולני PLN
PZDR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
PZDR2Z BGN Cumcy	שבוע 2	
PZDR3Z BGN Cumcy	שבוע 3	
PZDRA BGN Cumcy	חודש 1	
PZDRB BGN Cumcy	חודש 2	
PZDRC BGN Cumcy	חודש 3	
PZDRD BGN Cumcy	חודש 4	
PZDRE BGN Cumcy	חודש 5	
PZDRF BGN Cumcy	חודש 6	
PZDRG BGN Cumcy	חודש 7	
PZDRH BGN Cumcy	חודש 8	
PZDRI BGN Cumcy	חודש 9	
PZDRJ BGN Cumcy	חודש 10	
PZDRK BGN Cumcy	חודש 11	
PZDR1 BGN Cumcy	שנה	ריבית להיוון מטבע מובל לירה טורקית TRY
BISTTREF Index	יום	
TYDR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
TYDR2Z BGN Cumcy	שבוע 2	
TYDRA BGN Cumcy	חודש 1	
TYDRB BGN Cumcy	חודש 2	
TYDRC BGN Cumcy	חודש 3	
TYDRD BGN Cumcy	חודש 4	
TYDRF BGN Cumcy	חודש 6	
TYDRI BGN Cumcy	חודש 9	
TYDR1 BGN Cumcy	שנה	

MPDR1T Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל פזו מקסיקני MXN
MPDRC Cumcy	חודש 3	
MPDRF Cumcy	חודש 6	
MPDRI Cumcy	חודש 9	ריבית להיוון מטבע מובל קורונה צ'כית CZK
CKDR1T BGN Cumcy	יום	
CKDR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
CKDR2Z BGN Cumcy	שבוע 2	
CKDRA BGN Cumcy	חודש 1	
CKDRB BGN Cumcy	חודש 2	
CKDRC BGN Cumcy	חודש 3	
CKDRD BGN Cumcy	חודש 4	
CKDRE BGN Cumcy	חודש 5	
CKDRF BGN Cumcy	חודש 6	
CKDRG BGN Cumcy	חודש 7	
CKDRH BGN Cumcy	חודש 8	
CKDRI BGN Cumcy	חודש 9	
CKDRJ BGN Cumcy	חודש 10	
CKDRK BGN Cumcy	חודש 11	
CKDR1 BGN Cumcy	שנה	

SADR1T BGN Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל ראנד דרום-אפריקאי ZAR
SADR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
SADR2Z BGN Cumcy	שבוע 2	
SADRA BGN Cumcy	חודש 1	
SADRB BGN Cumcy	חודש 2	
SADRC BGN Cumcy	חודש 3	
SADRD BGN Cumcy	חודש 4	
SADRE BGN Cumcy	חודש 5	
SADRF BGN Cumcy	חודש 6	
SADRG BGN Cumcy	חודש 7	
SADRH BGN Cumcy	חודש 8	
SADRI BGN Cumcy	חודש 9	
SADRJ BGN Cumcy	חודש 10	
SADRK BGN Cumcy	חודש 11	
SADR1 BGN Cumcy	שנה	ריבית להיוון מטבע מובל רופי אינדונזי IDR
IHDR1T Cumcy	יום	
IHDRA BGN Cumcy	חודש 1	
IHDRB BGN Cumcy	חודש 2	
IHDRC BGN Cumcy	חודש 3	
IHDR1 BGN Cumcy	שנה	

COREPO Index	יום	ריבית להיוון מטבע מובל פזו קולומביאני COP
CLNI1W Cumcy	שבוע 1	
CLNI2W Cumcy	שבוע 2	
CLNI1M Cumcy	חודש 1	
CLNI2M Cumcy	חודש 2	
CLNI3M Cumcy	חודש 3	
CLNI4M Cumcy	חודש 4	
CLNI5M Cumcy	חודש 5	
CLNI6M Cumcy	חודש 6	
CLNI9M Cumcy	חודש 9	
CLNI12M Cumcy	שנה	ריבית להיוון מטבע מובל פזו צ'יליאני CLP
CHOVCHOV Index	יום	
CHNI1W BGN Cumcy	שבוע 1	
CHNI2W BGN Cumcy	שבוע 2	
CHNI1M BGN Cumcy	חודש 1	
CHNI2M BGN Cumcy	חודש 2	
CHNI3M BGN Cumcy	חודש 3	
CHNI4M BGN Cumcy	חודש 4	
CHNI5M BGN Cumcy	חודש 5	
CHNI6M BGN Cumcy	חודש 6	
CHNI7M BGN Cumcy	חודש 7	
CHNI8M BGN Cumcy	חודש 8	
CHNI9M BGN Cumcy	חודש 9	
CHNI12M BGN Cumcy	שנה	

PIRCORRP Index	יום	ריבית להיוון מטבע מובל פזו פיליפיני PHP
PPNI1W BGN Cumcy	שבוע 1	
PPNI2W BGN Cumcy	שבוע 2	
PPNI1M BGN Cumcy	חודש 1	
PPNI2M BGN Cumcy	חודש 2	
PPNI3M BGN Cumcy	חודש 3	
PPNI4M BGN Cumcy	חודש 4	
PPNI5M BGN Cumcy	חודש 5	
PPNI6M BGN Cumcy	חודש 6	
PPNI7M BGN Cumcy	חודש 7	
PPNI8M BGN Cumcy	חודש 8	
PPNI9M BGN Cumcy	חודש 9	
PPNI12M BGN Cumcy	שנה	
HFDR1T BGN Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל פורנט הונגרי HUF
HFDR1Z BGN Cumcy	שבוע 1	
HFDR2Z BGN Cumcy	שבוע 2	
HFDR3Z BGN Cumcy	שבוע 3	
HFDR1M BGN Cumcy	חודש 1	
HFDR2M BGN Cumcy	חודש 2	
HFDR3M BGN Cumcy	חודש 3	
HFDR4M BGN Cumcy	חודש 4	
HFDR5M BGN Cumcy	חודש 5	
HFDR6M BGN Cumcy	חודש 6	
HFDR9M BGN Cumcy	חודש 9	
HFDR1Y BGN Cumcy	שנה	

TBDR1T CMPN Cumcy	יום	ריבית להיוון מטבע מובל באט תאילנדי THB
TBDR1Z CMPN Cumcy	שבוע 1	
TBDR1M CMPN Cumcy	חודש 1	
TBDR2M CMPN Cumcy	חודש 2	
TBDR3M CMPN Cumcy	חודש 3	
TBDR6M CMPN Cumcy	חודש 6	
TBDR9M CMPN Cumcy	חודש 9	
TBDR1Y CMPN Cumcy	שנה	

## נספח ג'

A	
	1
נקודות פורחורד המגלמות פער ריביות לצמדי מטבעות שיש להן BFIX	2
"=BFxForward("USDILS",A6,"midpoints","ForwardSource=BFIX","spotSource=BFIX","HOLIDAYVALUES=TRUE","PRICINGDATE",A9)"	3
	4
תאריך סיום העיסקה	5
12/12/2018 (דוגמא)	6
	7
תאריך נכונות נקודות הפורחורד	8
17/08/2018 (דוגמא)	9
	10
	11
נקודות פורחורד המגלמות פער ריביות לצמדי מטבעות ללא BFIX	12
"=BFxForward("CADILS",A16,"midpoints","ForwardSource=BFIX","spotSource=BFIX","via=USD","HOLIDAYVALUES=TRUE","PRICINGDATE",A19)"	13
	14
תאריך סיום העיסקה	15
12/12/2018 (דוגמא)	16
	17
תאריך נכונות נקודות הפורחורד	18
17/08/2018 (דוגמא)	19