



# רשות ניירות ערך

## מחלקת הפיקוח על הבורסה

### וזירות המסחר

רח' מונטיפיורי 35, תל אביב 65201

טל': 03-7109970/1

פקס': 03-7109901

[www.isa.gov.il](http://www.isa.gov.il)

09 מרץ 2015  
י"ח אדר תשע"ה

[תאריך עדכון 21.03.2017]

להלן מידע אודות מבנה קובץ TXT – "חישוב הקצאה בגין סיכוני שוק - קיזוז מכשירים פיננסיים זהים", אשר מצורף לטבלה 1 בטופס ז013 "דוח חישוב הקצאות בשל סיכונים והון עצמי רגולטורי (הקצאות בשל סיכוני שוק)". הקובץ כולל מידע אודות אופן קיזוז פוזיציות הפוכות ברכיבי סיכון שיש להם אותו נכס בסיס, ובלבד שהן נובעות ממכשירים פיננסיים שתנאיהם זהים. המידע ניתן להצגה ולעיבוד באמצעות גיליון אלקטרוני בהתאם להנחיות המפורטות להלן. ניתן לערוך את המידע באמצעות קובץ גיליון אלקטרוני (דוגמת Excel) בהתאם להנחיות המפורטות להלן.

אנשי קשר: אסף ארז; עו"ד עמית טימור;

טלפון: 03-7109970, פקס: 03-7109901

### מבנה הקובץ

#### 1. שם הקובץ:

הדוח ידווח לרשות כקובץ מסוג Text (tab delimited), ויכיל נתונים אודות אופן חישוב סך הערך המחושב של כל רכיבי סיכון השוק הכולל קיזוז פוזיציות הפוכות ברכיבי סיכון שיש להם אותו נכס בסיס, ובלבד שהן נובעות ממכשירים פיננסיים שתנאיהם זהים. הקובץ ידווח באמצעות טופס דיווח ז013. שם הקובץ יישמר בתצורה של "3YYYYMMDD\_F\_ZZZ.TXT", כאשר:

– "3" – סוג הקובץ

3 – קובץ "חישוב סך הערך המחושב של רכיבי סיכון השוק";

– "YYYY" – השנה אליה מתייחס הדוח;

– "MM" – החודש שאליו מתייחס הדוח (קרי, חודש ינואר - 01);

- "DD" – היום שאליו מתייחס הדוח (קרי, ראשון לחודש - 31);
- "F" – תקופת הדוח – M לחודשי, Q לרבעוני, Y לשנתי;
- "ZZZ" – שם החברה המדווחת באנגלית (שלוש האותיות הראשונות של שם החברה באנגלית – ללא רווחים).

תווים בעברית הנכללים בקובץ המדווח יהיו מסוג עברית UTF-8. ההפרדה בין השורות תתבצע באמצעות CR (ASCII 13) ו-LF (ASCII 10). (בהכנת קובץ TXT באמצעות גיליון אלקטרוני כגון גיליון Excel ההפרדה נעשית באופן אוטומטי כאשר הקובץ נשמר תחילה כ-TXT (TAB delimited) ולאחר מכן נשמר כ-UTF-8).

## 2. מבנה רשומה:

- א. כל רשומה (שורה) תהיה מורכבת משדות כאמור בסעיף 4 - אופן הזנת הנתונים שלהלן ובטבלת "מבנה רשומה" לפי הסדר המפורט בה.
- ב. מספר התווים בכל שדה לא יעלה על מספר התווים המפורט בסעיף 4.
- ג. שדות יופרדו על ידי התו TAB (ASCII 9). (בהכנת קובץ TXT באמצעות גיליון אלקטרוני כגון גיליון Excel ההפרדה נעשית באופן אוטומטי כאשר הקובץ נשמר תחילה כ-TXT (TAB delimited) ולאחר מכן נשמר כ-UTF-8).
- ד. בשדה נומרי יוצגו ספרות, נקודה עשרונית וסימן מינוס.
- ה. ככל שהערך בשדה הינו שלילי, יש להוסיף סימן מינוס משמאל הערך (לדוגמה: "1233511.25").
- ו. הטיפול בערכים לא רלוונטיים – בשדה שאינו רלוונטי למכשיר פיננסי מסוים, יוזן הערך "0".

## 3. הערות כלליות:

- א. לחברה המבקשת רישיון - ניתן להזין ערכים בהתאם להגדרת השדה הרלוונטית ובהתאם למבנה הדוגמאות המפורטות בנספח א'; לחברה בעלת רישיון – יש לבחור ערך מתוך טבלאות הערכים בנספח ב'.
- ב. ככל שיעלה צורך לשנות או להוסיף ערכים לטבלאות הערכים הנכללים בקובץ (נספח ב'), יש לפנות לרשות.
- ג. ככל שיעשה שינוי או הוספה של ערכים לטבלאות הערכים הנכללים בקובץ (נספח ב'), הרשות תפרסם הודעה בהתאם.
- ד. אין לאחד או למזג שדות או רשומות.
- ה. אין להוסיף רשומות מעבר לרשומות בגין כל מכשיר פיננסי.
- ו. הנתונים יוצגו במטבע דיווח.
- ז. הנתונים ימוינו על פי השדות הבאים: שם המכשיר הפיננסי, שם מלא נכס בסיס.

ח. שערי החליפין שהשתמשה החברה במסגרת דוח זה יפורטו בטבלה בסעיף 3  
 בטופס הדיווח ז'012.

4. אופן הזנת הנתונים:

מספר שדה	שם השדה	מספר בתים	הגדרה	מהות השדה
<b>סוג רשומה: 01 - HEADER</b>				
1.	סוג רשומה	2	9(2)	ערך = 01
2.	שם חברה	40	x[40]	השם יוצג באנגלית
3.	תקופת הדוח	40	x[40]	בחירת אחד מהערכים הבאים: Month/Quarter/Year
4.	תאריך נכונות הנתונים	8	9(8)	YYYYMMDD
5.	תאריך הפקת הדוח	8	9(8)	YYYYMMDD

מספר שדה	שם השדה	מספר בתים	הגדרה	מהות השדה
<b>סוג רשומה: 02 - פרטי פוזיציות</b>				
1.	סוג רשומה	2	9(2)	ערך = 02
2.	שם המכשיר הפיננסי	100	x[100]	ערך מטבלה 1  (לחברה המבקשת רישיון - בהתאם לדוגמאות בנספח א'; לחברה בעלת רישיון - יש לבחור ערך מתוך הטבלה בנספח ב')
3.	Instrument_I D	100	x[100]	מזהה חד ערכי (למכשיר פיננסי - כפי שדווח בטופס ז'007).

מספר שדה	שם השדה	מספר בתים	הגדרה	מהות השדה
.4	Instrument_ Status_Code	1	9(1)	Number
				קוד
				1 פעיל למסחר
				2 פעיל לסגירת פוזיציות בלבד
3 לא פעיל למסחר				
.5	שם מלא נכס בסיס	100	x[100]	ערך מטבלה 2  (לחברה המבקשת רישיון – בהתאם לדוגמאות בנספח א'; לחברה בעלת רישיון – יש לבחור ערך מתוך הטבלה בנספח ב')
.6	סימול רכיב סיכון ראשון (ראשי)	50	x[50]	ערך מטבלה 3  (לחברה המבקשת רישיון – בהתאם לדוגמאות בנספח א'; לחברה בעלת רישיון – יש לבחור ערך מתוך הטבלה בנספח ב')
.7	סיווג רכיב סיכון ראשון	10	x[10]	בהתאם לסוגי רכיבי סיכון השוק המפורטים בתקנה 83
.8	ערך מחושב רכיב סיכון ראשון (ראשי) פוזיציות לונג	18	9(15.2)	ערך חיובי בלבד
.9	ערך מחושב רכיב סיכון ראשון (ראשי)	18	-9(15.2)	ערך שלילי בלבד

מספר שדה	שם השדה	מספר בתים	הגדרה	מהות השדה
	פוזיציית שורט			
.10	ערך מחושב רכיב סיכון ראשון (ראשי) לאחר קיזוז	15	9(12.2)	ערך חיובי או שלילי
.11	סימול רכיב סיכון שני (משני)	50	x[50]	ערך מטבלה 3  (לחברה המבקשת רישיון – בהתאם לדוגמאות בנספח א'; לחברה בעלת רישיון – יש לבחור ערך מתוך הטבלה בנספח ב')
.12	סיווג רכיב סיכון שני	10	x[10]	בהתאם לסוגי רכיבי סיכון השוק המפורטים בתקנה 83
.13	ערך מחושב רכיב סיכון שני (משני) פוזיציית לונג	18	9(15.2)	ערך חיובי בלבד
.14	ערך מחושב רכיב סיכון שני (משני) פוזיציית שורט	18	-9(15.2)	ערך שלילי בלבד
.15	ערך מחושב רכיב סיכון שני (משני) לאחר קיזוז	15	9(12.2)	ערך חיובי או שלילי

מספר שדה	שם השדה	מספר בתים	הגדרה	מהות השדה
<b>TRAILER - 99 : סוג רשומה</b>				

1.	סוג רשומה	2	9(2)	ערך = 99
2.	מספר רשומות	6	9(6)	מספר הרשומות הפיזיות כולל 02,01 ו-99

להלן פירוט טבלאות הערכים הנכללים בקובץ:

**נספח א' – דוגמאות**

טבלה 1 - "שם המכשיר הפיננסי" - דוגמה:

חווה הפרשים
אחר

טבלה 2 - "שם מלא נכס בסיס" - דוגמאות:

Australian Dollar/Canadian Dollar
Australian Dollar/Swiss Franc
Australian Dollar/Japanese Yen
Australian Dollar/New Zealand Dollar
Australian Dollar/U.S. Dollar
Canadian Dollar/Swiss Franc
Canadian Dollar/Japanese Yen

טבלה 3 - "סימול רכיב סיכון ראשון וסימול רכיב סיכון שני" - דוגמאות:

AUD
CAD
CHF
EUR
JPY
NZD
USD

**נספח ב'**

טבלה 1 - "שם המכשיר הפיננסי":

חווה הפרשים
אחר

טבלה 2 - "שם מלא נכס בסיס":

10 Year T Note Future
5 Year T Note future
ASX SPI 200 Index Future
Australian Dollar vs Canadian Dollar
Australian Dollar vs Japanese Yen
Australian Dollar vs New Zealand Dollar
Australian Dollar vs Singaporean Dollar
Australian Dollar vs Swiss Franc
Australian Dollar vs US Dollar
Brent Crude future
CAC 40 Index Spot
CAC40 Index Future
Canadian Dollar vs Japanese Yen
Canadian Dollar vs Swiss Franc
Chicago SRW Wheat Future
Cocoa future
Coffee C &#174; future
Copper future
Corn future
Cotton No 2 Future
Crude Oil future WTI
Danish Krone vs Norwegian krone
DAX Index Future
DAX Index Spot
Dow Jones Industrial Average Index Spot
E mini Dow (\$5) Future
E mini NASDAQ 100 Future
E mini S&P 500 Future
Euro Bund Future
EURO STOXX 50 Index Future
EURO STOXX 50 Index Spot
Euro vs Australian Dollar
Euro vs Canadian Dollar
Euro vs Danish Krone
Euro vs Great Britain Pound
Euro vs Israeli Shekel
Euro vs Japanese Yen
Euro vs Mexican Peso
Euro vs New Zealand Dollar
Euro vs Norwegian Krone
Euro vs Polish Zloty

Euro vs Singapore Dollar
Euro vs South African Rand
Euro vs Swedish Krone
Euro vs Swiss Franc
Euro vs US Dollar
FTSE 100 Index Future
FTSE 100 Index Spot
Gold Usd Spot Rate
Great Britain Pound vs Australian Dollar
Great Britain Pound vs Canadian Dollar
Great Britain Pound vs Danish Krone
Great Britain Pound vs Israeli Shekel
Great Britain Pound vs Japanese Yen
Great Britain Pound vs New Zealand Dollar
Great Britain Pound vs Norwegian Krone
Great Britain Pound vs Polish Zloty
Great Britain Pound vs Singaporean Dollar
Great Britain Pound vs South African Rand
Great Britain Pound vs Swedish Krone
Great Britain Pound vs Swiss Franc
Great Britain Pound vs US Dollar
Hang Seng Index Future
Hang Seng Index Spot
Henry Hub Natural Gas future
NASDAQ 100 Index Spot
New Zealand Dollar vs Canadian Dollar
New Zealand Dollar vs Japanese Yen
New Zealand Dollar vs Swiss Franc
New Zealand Dollar vs US Dollar
Nikkei 225 Index Future
NIKKEI 225 Index Spot
Nikkei/Yen Futures (OSE)
NY Harbor ULSD Future
Palladium future
Palladium Usd Spot Rate
Platinum Future
Platinum Usd Spot Rate
RBOB Gasoline Future
RUSSEL 2000 Index Spot
Russell 2000® Index Mini future
S&P 500 Index spot
S&P/ASX 200 Index spot
SGX 10 Yr Mini Japanese Gvt Bond Future
SGX Nikkei 225 Index Future



Silver Usd Spot Rate
SMI Index future
South African Rand vs Japanese Yen
Soybean Future
Sugar No 11 future
Swedish Krone vs Norwegian Krone
Swiss Franc vs Danish Krone
Swiss Franc vs Japanese Yen
Swiss Franc vs Norwegian Krone
Swiss Franc vs Swedish Krone
U.S. Treasury Bond future
US Dollar Index&reg; future
US Dollar vs Canadian Dollar
US Dollar vs Chinese Yuan
US Dollar vs Danish Krone
US Dollar vs Hong Kong Dollar
US Dollar vs Israeli Shekel
US Dollar vs Japanese Yen
US Dollar vs Mexican Peso
US Dollar vs Norwegian Krone
US Dollar vs Polish Zloty
US Dollar vs Singaporean Dollar
US Dollar vs South African Rand
US Dollar vs South Korean Won
US Dollar vs Swedish Krone
US Dollar vs Swiss Franc
שמות נכסי הבסיס מסוג מניות שאושרו לחברה מבורסת NYSE יש להציג בדיווח כפי שמופיע באתר הבורסה בהתאם לשדה NAME באתר. <a href="https://www.nyse.com/listings_directory/stock">https://www.nyse.com/listings_directory/stock</a>
שמות נכסי הבסיס מסוג מניות שאושרו לחברה מבורסת NASDAQ יש להציג בדיווח כפי שמופיע באתר הבורסה בהתאם לשדה NAME באתר. <a href="http://www.nasdaq.com/screening/companies-by-name.aspx?letter=A&amp;sortname=marketcap&amp;sorttype=1">http://www.nasdaq.com/screening/companies-by-name.aspx?letter=A&amp;sortname=marketcap&amp;sorttype=1</a>

**טבלה 3 - "סימול רכיב סיכון ראשון וסימול רכיב סיכון שני":**

Australian Dollar
Canadian Dollar
Swiss Franc
Euro
Great Britain Pound
New Zealand Dollar
U.S. Dollar
Japanese Yen
Danish Krone

Israeli Shekel
Norweigen Krone
Polish Zloty
Swedish krona
South African Rand
Singaporean Dollar
Chinese Yuan
Hong Kong Dollar
South Korean Won
Mexican Peso
10 Year T Note Future
5 Year T Note future
ASX SPI 200 Index Future
Brent Crude future
CAC 40 Index Spot
CAC40 Index Future
Canadian Light Sweet Oil (Net Energy) Index Futures
Chicago SRW Wheat Future
Cocoa future
Coffee C &#174; future
Copper future
Corn future
Cotton No 2 Future
Crude Oil future WTI
DAX Index Spot
DAX Index Future
Dow Jones Industrial Average Index Spot
E mini Dow (\$5) Future
E mini NASDAQ 100 Future
E mini Natural Gas Future
E mini S&P 500 Future
EURO STOXX 50 Index Spot
EURO STOXX 50 Index Future
Euro Bund Future
FTSE 100 Index Spot
FTSE 100 Index Future
Gold Usd Spot Rate
Hang Seng Index Spot
Hang Seng Index Future
Henry Hub Natural Gas future
South African Rand vs Japanese Yen
MDAX Index Future
NASDAQ 100 Index Spot
NIKKEI 225 Index Spot

Nikkei 225 Index Future
NY Harbor ULSD Future
Palladium Usd Spot Rate
Palladium future
Platinum Usd Spot Rate
Platinum Future
RBOB Gasoline Future
Rough Rice Future
RUSSEL 2000 Index Spot
Russell 2000® Index Mini future
S&P 500 Index spot
S&P/ASX 200 Index spot
SGX 10 Yr Mini Japanese Gvt Bond Future
SGX Nikkei 225 Index Future
Silver Usd Spot Rate
US Dollar Index® future
SMI Index future
Soybean Future
Sugar No 11 future
U.S. Treasury Bond future