بيروت في ٢٠٠٧/٤/٢٤

## مذكرة رقم ٧/٥ منكرة وقم ٢٠٠٧/ موجهة إلى جميع المصارف العاملة في لبنان

الموضوع: معلومات حول محفظة الأسهم والسندات.

ضمن إطار الإختبارات الكمية التي تقوم بإجرائها دورياً لجنة الرقابة على المصارف حول مدى تأثير تطبيق متطلبات إتفاقية بازل ٢ الدولية حول كفاية رأس المال على مستوى الملاءة في القطاع المصرفي اللبناني، يطلب من جميع المصارف تزويد اللجنة في مهلة أقصاها ٢٠٠٧/٤/٢٧ بما يلى:

- المعلومات الواردة في النموذج رقم ١ المرفق عن محفظة السندات والأسهم المصنفة "مشتراة بغرض المتاجرة" كما في ٢٠٠٦/٦/٣٠ بحسب الوضعية الإفرادية والمجمعة حيث ينطبق.
- الأرباح/الخسائر المحققة نتيجة لعمليات بيع الأدوات المالية المصنفة ضمن المحفظة المصرفية (Banking Book) فقط والتي تشمل حصراً تلك المصنفة مشتراة حتى الإستحقاق، تسليفات وذمم مدينة ومتوفرة للبيع، وذلك عن الفترة الممتدة ما بين ٢٠٠٤/٦/٣٠ و ٢٠٠٤/٦/٣٠ ضمناً وبشكل نصف سنوي كما هو وارد في الملحق رقم ٢ المرفق، بحسب الوضعية الإفرادية والمجمعة حيث ينطبق.

رئيس لجنة الرقابة على المصارف

وليد علم الدين

مرفقات : نموذج رقم ۱ نموذج رقم ۲ لجنة الرقابة على المصار ف

## نموذج رقم ١: وضعية محفظة السندات والأسهم المصنفة "مشتراة بغرض المتاجرة" كما في ٣٠٠٦/٦/٣٠

وضعية : 🔲 إفرادية	سم ورقم المصرف:
□ محمعة	

وضعية محفظة السندات ( المصنفة للمتاجرة كما في ٢٠٠٦/٦/٣٠

γ, γ, γ, σ σ σ σ σ σ σ σ σ σ σ σ σ σ σ σ										
تاريخ إعادة ه	عدد الأيام	تاريخ	ما يعادل القيمة السوقية	القيمة السوقية	القيمة الإسمية	قسيمة	العملة '	التصنيف الإئتماني	المُصدر	نوع السند <sup>٢</sup>
			(القيم بالآلاف)	(القيم بالآلاف)	(القيم بالآلاف)	(Coupon)		، ہِ ۔۔۔۔ی		
							······			
		•								

- ا تشمل كافة أنواع سندات الدين (Debt Securities) والأدوات المالية المنتجة للفوائد (Interest Rate related Instruments) بما فيها تلك التي تحمل فائدة ثابتة (Floating Rate Instruments) والأدوات المالية المنتجة للفوائد (Rate Instruments) والأدوات المالية المنتجة للفوائد (Rate Instruments)
- ٢ ذكر نوع السند/الأداة (سندات خزينة، يوروبوند، شهادات إيداع، سندات دين الشركات، أدوات مركبة، إلخ...) مع الإشارة إذا كان يحمل قسيمة فائدة ثابتة أو متغيرة (يعاد تسعيرها)
  - ٣ التصنيفُ الإئتماني للمُصدر أو للسند (إذا توفر) حسب Standard and Poors أو Moody's أو Fitch Ratings
    - ٤ يوضع رمز العملة
    - o للسندات ذات قسيمة الفائدة المتغيرة (Floating Rate Instruments)

مذكرة إلى المصارف رقم ٢٠٠٧/٥ لجنة الرقابة على المصارف

وضعية محفظة الأسهم المصنفة للمتاجرة كما في ٢٠٠٦/٦/٣٠

	1 1	٠.	16 -	•	
ما يعادلها بالليرة اللبنانية (القيم بالآلاف)	القيمة الإجمالية حسب (القيم بالآلاف)	السعر السوقي	عدد الأسهم	العملة (يوضع رمز العملة)	السهم

, الهاتف المباشر	ر قم	هذا البيان:	سے استعبار کی ا
• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	<u> </u>	🔾 🚜	J.

للإستفسارات والمزيد من الإيضاحات يرجى الإتصال بلجنة الرقابة على المصارف كما يلي :

financialriskunit@bccl.gov.lb : عنوان البريد الإلكتروني

مذكرة إلى المصارف رقم ٢٠٠٧/٥ لجنة الرقابة على المصارف

وضعية: 🗖 إفرادية	إسم ورقم المصرف :
□ مجمعة	

من ۲۰۰۲/۷/۱	من ۲۰۰۶/۱/۱ إلى ۲۰۰۶/۶/۳۰	من ۷۰۰۰/۷/۱	من ۲۰۰۰/۱/۱ إلى ۲۰۰۰/۶/۳۰	من ۲۰۰٤/۷/۱	من ۲۰۰٤/۱/۱ إلى ۲۰۰٤/٦/۳۰	الفترة الزمنية
						مجموع الأرباح/الخسائر <sup>*</sup> (بآلاف الليرات اللبنانية)

ا المحفظة المصرفية تشمل فقط الأدوات المالية المصنفة "مشتراة حتى الإستحقاق" (Held-to-Maturity) و "تسليفات وذمم مدينة" (Loans and Receivables) و "متوفرة للبيع" (Available-for-Sale)

٢ مجموع الأرباح/الخسائر المحققة نتيجة لعمليات بيع منفذة على الأدوات المالية المصنفة ضمن المحفظة المصرفية كما هو مُعرف عنها أعلاه

إسم المسؤول عن تحضير هذا البيان: رقم الهاتف المباشر:

للإستفسارات والمزيد من الإيضاحات يرجى الإتصال بلجنة الرقابة على المصارف كما يلي:

◄ رقم الهاتف: ١-٧٥٠٠٠٠ • السيد محمد علي حسن: مقسم ٢٢٤٦
• السيد محمد الخليل: مقسم ٢٢٨٢

financialriskunit@bccl.gov.lb : عنوان البريد الإلكتروني