

تعليمات الرقابة المصرفية
رقم ١٧ تاريخ ٢٠٠٥/٢/١٣

صادرة عن مجلس النقد والتسليف بالقرار رقم (١٠٧/ن/ب/٤) وتاريخ ٢٠٠٥/٢/١٣
المصدق من قبل السيد رئيس مجلس الوزراء

الجمهورية العربية السورية
مجلس النقد والتسليف

(/ /)

() () () (-) (-)
/ / / /

"

//

:

-

.

.

-

//

-

·
·

-

-

·

-

·

-

·

-

·

-

·

-

·

-

·

-

·

-

·

-

·

(Yield curve) (Repricing Risk)
 (Basis Risk)
 . () (Option Risk)

() () ())
 : ()
 (Gap Analysis) -
 (Duration Analysis) -
 (Economic Value Analysis) -
 (Simulation Analysis) -

(Gap Analysis)
 (Duration Analysis)

()

(Stress Test)

-

:

-

.

-

. (Stress Test)

-

-

.

-

.

:

-

.

-

.

-

.

-

-

.

-

.

:

-

(Gap Analysis)

:

-

()

. ()

-

. (Gap)

(Cumulative Gap) -

.

-

.

-

.

-

· %

-

·
(Average Duration) -

·
:

(Average Duration)

() -
() ()
· () -

· () ()

_____:

-

() ()
CD ROM

.

-

.

//

نمذج رقم ١

*

(-)	
(-)	()
	()

" .

" ()

*

.....
.....

()											 :		
	*												
		-	-	-	-	-	-	-	-				

[illegible][illegible]

.....
.....

()											 :		
	*												
		-	-	-	-	-	-	-	-				

[illegible][illegible]

■ ■

()

[illegible][illegible]

()

*

[illegible]

.....

()

..... :

	**** ()	*** ()	()×()=()	** ()	()	* ()	()

. () () *

() **

(+) () ***

() () ****

() _____

(**Repricing Risk**) _____

(Gaps)

.

(**Yield Curve Risk**) _____

.

(**Basis Risk**) _____

(Libor)

(Prime Rate)

.

(Option Risk)

(Callable Bond)

.

.

() _____

_____ : () _____

. %

:

()	()	%	()	
× =()	()	()	()	()
, , , , , _____, ,	, , , , , _____, ,	, , , , , ,		

: (Average Duration) -

, = _____, = / ()

.

/

: (Modified Duration) -

$$\% , = (, +) / , = (+) / ()$$

. (%)

() %
)

%

. (

: ()

:

()

:

:

/

()	%		()	()	
()×()=()	()	()×()=()	()	()	()
, , , , _____ ,	, , , , ,	 _____	, , , , ,	 _____	

/
=
-

,
=
/
=

%
,

.

.

,
,

. (, + ,) - , ÷ ,

.

/