Published on (https://bnm.md)

25.06.2015

Валютные активы и обязательства лицензированных банков в мае 2015 года

(молдавские леи)		Данные с учетом активов и обязательств, привязанных к курсу иностранной валюты		
		Остаток		Удельный вес
		на конец месяца	среднемесячный	среднемесячного остатка
A.	Всего валютных активов (A.1+A.2+A.3)	51.601.617.412	52.208.987.683	100,0%
	Всего балансовых валютных активов (A.1+A.3)	50.718.564.272	51.086.569.507	97,9%
A.1	Всего балансовых активов в иностранной валюте (исключая регулирующую статью)	49.510.721.114	49.884.038.927	95,6%
	в т.ч.по категориям			
1	Ликвидные активы в иностранной валюте	12.078.523.012	12.391.250.759	23,7%
(i)	Наличность	1.547.720.909	1.598.957.583	3,1%
(ii)	Счета «Ностро», открытые за границей	8.370.501.225	8.809.102.547	16,9%
(iii)	Размещения за границей лицензированных банков	1.261.295.878	1.334.357.285	2,5%
(iv)	Кредиты овернайт и средства, размещенные овернайт	880.128.118	629.553.579	1,2%
(v)	Ценные бумаги	18.876.882	19.279.764	0,0%
2	Кредиты, предоставленные в иностранной валюте	17.019.459.741	16.915.115.618	32,4%
3	Обязательные резервы в иностранной валюте, размещенные в НБМ	3.929.649.966	3.961.062.984	7,6%
4	Регулирования и скидки на потери от обесценения	-4.232.556.654	-4.245.402.937	-8,1%
5	Прочие балансовые активы в	20.715.645.049	20.862.012.503	40,0%

	иностранной валюте (A1-1-2-3-4)			
A.2	Всего условных (внебалансовых) активов в иностранной валюте	883.053.140	1.122.418.176	2,1%
	в т.ч.по категориям			
1	Покупки по срочным сделкам в иностранной валюте	302.558.289	313.014.681	0,6%
2	Прочие условные активы в иностранной валюте	580.494.851	809.403.495	1,5%
A.3	Всего активов, привязанных к курсу иностранной валюты	1.207.843.158	1.202.530.580	2,3%
	в т.ч.по категориям			
1	Привязанные предоставленные кредиты	1.264.568.856	1.257.797.342	2,4%
2	Регулирования и скидки на потери от обесценения	-66.483.984	-65.387.728	-0,1%
3	Прочие привязанные активы	9.758.286	10.120.966	0,0%
B.	Всего валютных обязательств (B.1+B.2+B.3)	43.748.495.694	44.651.322.606	100,0%
	Всего балансовых валютных обязательств (B.1+B.3)	42.458.304.785	43.122.234.779	96,6%
B.1	Всего балансовых обязательств в иностранной валюте (исключая регулирующую статью)	42.458.304.785	43.122.234.779	96,6%
	в т.ч.по категориям			
1	Счета «Лоро» в иностранной валюте иностранных банков	16.949.805	16.758.854	0,0%
2	Срочные депозиты в иностранной валюте иностранных банков	470.306.880	471.138.181	1,0%
3	Текущие счета клиентов в иностранной валюте	6.914.762.607	7.000.405.311	15,7%
4	Срочные депозиты клиентов в иностранной валюте	16.704.701.850	17.137.540.312	38,4%
5	Прочие депозиты клиентов в иностранной валюте	3.714.417.045	3.695.911.546	8,3%
6	Кредиты, полученные в иностранной валюте	4.442.377.407	4.542.328.920	10,2%
8	Регулирования	-10.337.705	-10.621.349	0,0%
7	Прочие балансовые обязательства в иностранной валюте (B1-1-2-3-4-5-6-7)	10.205.126.896	10.268.773.003	23,0%

B.2	Всего условных (внебалансовых) обязательств в иностранной валюте	1.290.190.909	1.529.087.827	3,4%
	в т.ч.по категориям			
1	Продажи по срочным сделкам в иностранной валюте	624.940.012	614.275.124	1,4%
2	Прочие условные обязательства в иностранной валюте	665.250.897	914.812.703	2,0%
B.3	Всего обязательств, привязанных к курсу иностранной валюты	0	0	0,0%
	в т.ч.по категориям			
1	Привязанные полученные кредиты	0	0	0,0%
2	Прочие привязанные обязательства	0	0	0,0%
C.	Величина открытой валютной позиции			
1	Длинной*	7.984.879.167	7.723.883.373	100,0%
(i)	Евро	3.858.715.555	3.817.750.248	49,4%
(ii)	Доллары США	3.982.231.937	3.736.992.402	48,4%
(iii)	Российские рубли	112.469.933	129.100.386	1,7%
(iv)	Румынские леи	9.605.385	8.649.182	0,1%
(v)	Другие иностранные валюты	21.856.357	31.391.154	0,4%
2	Короткой**	-131.904.187	-166.369.052	100,0%
(i)	Евро	-100.345.787	-71.216.391	42,8%
(ii)	Доллары США	-6.488.025	-58.304.565	35,1%
(iii)	Российские рубли	-21.382.977	-34.813.659	20,9%
(iv)	Румынские леи	-468.998	-199.954	0,1%
(v)	Другие иностранные валюты	-3.218.400	-1.834.483	1,1%
D.	Совокупный нормативный капитал	9.543.543.959	9.515.947.301	
E.	Отношение открытой валютной позиции в %			
1	Длинной***			
(i)	Евро	40,43	40,12	
(ii)	Доллары США	41,73	39,27	
(iii)	Российские рубли	1,18	1,36	
(iv)	Румынские леи	0,10	0,09	
(v)	Другие иностранные валюты	0,23	0,33	
2	Короткой****			

(i)		Евро	-1,05	-0,75	
(ii)		Доллары США	-0,07	-0,61	
(iii)		Российские рубли	-0,22	-0,37	
(iv)		Румынские леи	0,00	0,00	
(v)		Другие иностранные валюты	-0,03	-0,02	

**Величина длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца 188,17 млн.MDL в том числе в Евро:7,27 млн.MDL; Долларах США: 137,99 млн.MDL; Росийских Рублях: 23,36 млн.MDL

**Величина короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца -111,62 млн.MDL в том числе в Евро:-100,35 млн.MDL; Долларах США: -6,49 млн.MDL; Росийских Рублях: -1,1 млн.MDL

***Отношение длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро: 0,09 %; Долларах США: 1,64 %; Росийских Рублях: 0,28 %

****Отношение короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро:-1,19 %; Долларах США: -0,08 %; Росийских Рублях: -0,01 %

Информация о валютных активах и обязательствах лицензированных банков составляется на основании отчетов об открытой валютной позиции банка, представляемых лицензированными банками в соответствии с Регламентом по открытой валютной позиции банка [1].

Опубликованная информация содержит агрегированные данные по валютным активам и обязательствам лицензированных банков, открытой валютной позиции, совокупному нормативному капиталу, отношению открытой валютной позиции.

Информация о валютных активах и обязательствах лицензированных банков представлена следующим образом:

*1) **валютные активы,*** которые включают:

a) *балансовые валютные активы:*

- балансовые активы в иностранной валюте – наличность; средства на счетах «Ностро», открытых за границей; размещения за границей лицензированных банков; кредиты овернайт и средства, размещенные овернайт; ценные бумаги; выданные кредиты; обязательные резервы, размещенные в НБМ; прочие балансовые активы в иностранной валюте;
- активы в молдавских леях, привязанные к курсу иностранной валюты – предоставленные привязанные кредиты и прочие привязанные активы.

b)*условные (внебалансовые) активы в иностранной валюте* – покупки по срочным сделкам в иностранной валюте и прочие условные активы в иностранной валюте.

*2) **валютные обязательства,*** которые включают:

a) *балансовые валютные обязательства:*

- балансовые обязательства в иностранной валюте – средства на счетах «Лоро» иностранных банков; срочные депозиты иностранных банков; текущие счета клиентов; срочные депозиты клиентов; прочие депозиты клиентов; полученные кредиты; прочие балансовые обязательства в иностранной валюте;
- обязательства в молдавских леях, привязанные к курсу иностранной валюты – полученные привязанные кредиты и прочие привязанные обязательства.

b)*условные (внебалансовые) обязательства в иностранной валюте – продажи* по срочным сделкам в иностранной валюте и прочие условные обязательства в иностранной валюте.

Информация о валютных активах и обязательствах включает данные об остатках (пересчитанных в доллары США) валютных активов и обязательств на конец месяца. Определение эквивалента в долларах США упомянутых остатков осуществляется с применением официальных курсов молдавского лея по отношению к доллару США и соответствующей иностранной валюте, действующих на конец месяца.

Величина открытой валютной позиции представляет собой разницу между суммой валютных активов в определенной иностранной валюте и суммой валютных обязательств в соответствующей валюте. Информация о величине открытой валютной позиции представлена в абсолютном значении (в эквиваленте в долларах США) на конец месяца, отдельно для иностранных валют, которые наиболее часто являются объектом сделок (доллар США, евро, российский рубль, румынский лей), и для других иностранных валют.

Отношение открытой валютной позиции представляет собой отношение между величиной открытой валютной позиции и величиной совокупного нормативного капитала банков. Отношение открытой валютной позиции представлено в процентах на конец месяца по вышеуказанным иностранным валютам.

Информация о валютных активах и обязательствах лицензированных банков публикуется ежемесячно до последнего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

See also

Tags
Величина открытой валютной позиции [2]
совокупный нормативный капитал [3]
валютные активы [4]
Валютные обязательства [5]

Source URL:
https://bnm.md/en/node/52069

Related links:

[1] https://bnm.md/ru/content/reglament-po-otkrytoy-valyutnoy-pozicii-banka-utverzhdennyy-pas-nbm-no126-ot-28111997-g [2] https://bnm.md/en/search?hashtags[0]=Величина открытой валютной позиции [3] https://bnm.md/en/search?hashtags[0]=совокупный нормативный капитал [4] https://bnm.md/en/search?hashtags[0]=валютные активы [5] https://bnm.md/en/search?hashtags[0]=Валютные обязательства