Published on (https://bnm.md)

25.04.2015

Валютные активы и обязательства лицензированных банков в марте 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)	52.748.728.394	53.798.488.439	100,0%
	Всего балансовых валютных активов (A.1+A.3)	51.514.955.079	52.945.435.776	98,4%
A.1	Всего балансовых активов в иностранной валюте (исключая регулирующую статью)	50.304.010.935	51.752.626.902	96,2%
	в т.ч.по категориям			
1	Ликвидные активы в иностранной валюте	12.446.359.700	12.923.200.448	24,0%
(i)	Наличность	1.480.275.481	1.470.428.572	2,7%
(ii)	Счета «Ностро», открытые за границей	9.071.365.604	9.859.107.519	18,3%
(iii)	Размещения за границей лицензированных банков	972.037.300	956.031.839	1,8%
(iv)	Кредиты овернайт и средства, размещенные овернайт	905.029.063	614.276.964	1,1%
(v)	Ценные бумаги	17.652.252	23.355.553	0,1%
2	Кредиты, предоставленные в иностранной валюте	16.775.151.226	16.987.061.029	31,6%
3	Обязательные резервы в иностранной валюте, размещенные в НБМ	3.962.300.251	4.106.862.011	7,6%
4	Регулирования и скидки на потери от обесценения	-3.908.886.653	-3.613.651.369	-6,7%
5	Прочие балансовые активы в	21.029.086.411	21.349.154.782	39,7%

	иностранной валюте (A1-1-2-3-4)	21.629.080.411	21.549.154.762	39,7%
A.2	Всего условных (внебалансовых) активов в иностранной валюте	1.233.773.315	853.052.662	1,6%
	в т.ч.по категориям			
1	Покупки по срочным сделкам в иностранной валюте	412.544.837	306.416.238	0,6%
2	Прочие условные активы в иностранной валюте	821.228.478	546.636.424	1,0%
A.3	Всего активов, привязанных к курсу иностранной валюты	1.210.944.144	1.192.808.875	2,2%
	в т.ч.по категориям			
1	Привязанные предоставленные кредиты	1.267.558.002	1.247.932.276	2,3%
2	Регулирования и скидки на потери от обесценения	-66.369.519	-64.915.974	0,1%
3	Прочие привязанные активы	9.755.661	9.792.572	0,0%
B.	Всего валютных обязательств (B.1+B.2+B.3)	45.731.492.627	47.130.107.332	100,0%
	Всего балансовых валютных обязательств (B.1+B.3)	44.276.572.967	45.880.968.101	97,3%
B.1	Всего балансовых обязательств в иностранной валюте (исключая регулирующую статью)	44.276.572.967	45.880.958.998	97,3%
	в т.ч.по категориям			
1	Счета «Лоро» в иностранной валюте иностранных банков	17.384.714	17.337.984	0,0%
2	Срочные депозиты в иностранной валюте иностранных банков	496.957.140	502.339.765	1,1%
3	Текущие счета клиентов в иностранной валюте	7.216.294.531	7.812.331.863	16,6%
4	Срочные депозиты клиентов в иностранной валюте	17.631.237.379	17.978.745.200	38,1%
5	Прочие депозиты клиентов в иностранной валюте	3.515.255.755	3.543.916.221	7,5%
6	Кредиты, полученные в иностранной валюте	4.957.549.507	5.059.106.521	10,7%
8	Регулирования	-12.725.318	-13.199.126	0,0%
7	Прочие балансовые обязательства в иностранной валюте (B1-1-2-3-4-5-6-7)	10.454.619.259	10.980.380.569	23,3%

B.2	Всего условных (внебалансовых) обязательств в иностранной валюте	1.454.919.660	1.249.139.232	2,7%
	в т.ч.по категориям			
1	Продажи по срочным сделкам в иностранной валюте	633.973.766	654.671.917	1,4%
2	Прочие условные обязательства в иностранной валюте	820.945.894	594.467.315	1,3%
B.3	Всего обязательств, привязанных к курсу иностранной валюты	0	9.103	0,0%
	в т.ч.по категориям			
1	Привязанные полученные кредиты	0	0	0,0%
2	Прочие привязанные обязательства	0	9.103	0,0%
C.	Величина открытой валютной позиции			
1	Длинной*	7.088.294.271	6.769.122.683	100,0%
(i)	Евро	3.565.390.531	3.463.798.320	51,2%
(ii)	Доллары США	3.445.546.602	3.162.772.434	46,7%
(iii)	Российские рубли	55.465.198	106.521.542	1,6%
(iv)	Румынские леи	5.693.686	5.253.822	0,1%
(v)	Другие иностранные валюты	16.198.254	30.776.565	0,4%
2	Короткой**	-71.058.490	-100.740.730	100,0%
(i)	Евро	-12.387.017	-22.552.390	22,4%
(ii)	Доллары США	-12.438.204	-33.949.575	33,7%
(iii)	Российские рубли	-42.618.461	-42.828.094	42,5%
(iv)	Румынские леи	-181.646	-209.748	0,2%
(v)	Другие иностранные валюты	-3.433.162	-1.200.923	1,2%
D.	Совокупный нормативный капитал	9.211.232.219	9.187.590.985	
E.	Отношение открытой валютной позиции в %			
1	Длинной***			
(i)	Евро	38,71	37,70	
(ii)	Доллары США	37,41	34,42	
(iii)	Российские рубли	0,60	1,16	
(iv)	Румынские леи	0,06	0,06	
(v)	Другие иностранные валюты	0,18	0,34	
2	Короткой****			

(i)		Евро	-0,13	-0,25	
(ii)		Доллары США	-0,14	-0,37	
(iii)		Российские рубли	-0,46	-0,47	
(iv)		Румынские леи	0,00	0,00	
(v)		Другие иностранные валюты	-0,04	-0,01	

**Величина длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца 400,87 млн.MDL в том числе в Евро:78,47 млн.MDL; Долларах США: 277,61 млн.MDL; Росийских Рублях: 30,98 млн.MDL

**Величина короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца -28,44 млн.MDL в том числе в Евро:-12,39 млн.MDL; Долларах США: -12,44 млн.MDL; Росийских Рублях: 0 млн.MDL

***Отношение длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро: 0,97 %; Долларах США: 3,45 %; Росийских Рублях: 0,38 %

****Отношение короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро:-0,15 %; Долларах США: -0,15 %; Росийских Рублях: 0 %

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:

а)*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:

а)*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/52070

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