



25.05.2015

Валютные активы и обязательства лицензированных банков в апреле 2015 года

| (молдавские леи) | | Данные с учетом активов и обязательств, привязанных к курсу иностранной валюты | | |
|------------------|--|--|----------------|--|
| | | Остаток | | Удельный вес среднемесячного остатка |
| | | на конец месяца | среднемесячный | |
| A. | Всего валютных активов (A.1+A.2+A.3) | 51.537.608.016 | 51.120.015.292 | 100,0% |
| | Всего балансовых валютных активов (A.1+A.3) | 50.584.671.663 | 50.070.121.337 | 97,9% |
| A.1 | Всего балансовых активов в иностранной валюте (исключая регулируемую статью) | 49.381.817.251 | 48.905.966.737 | 95,7% |
| | в т.ч. по категориям | | | |
| 1 | Ликвидные активы в иностранной валюте | 12.230.299.949 | 12.035.540.138 | 23,6% |
| (i) | Наличность | 1.565.248.586 | 1.462.423.617 | 2,9% |
| (ii) | Счета «Ностро», открытые за границей | 8.795.471.621 | 8.856.543.413 | 17,3% |
| (iii) | Размещения за границей лицензированных банков | 1.389.405.141 | 1.072.301.060 | 2,1% |
| (iv) | Кредиты овернайт и средства, размещенные овернайт | 461.527.276 | 626.954.151 | 1,2% |
| (v) | Ценные бумаги | 18.647.325 | 17.317.898 | 0,1% |
| 2 | Кредиты, предоставленные в иностранной валюте | 16.556.529.578 | 16.370.572.303 | 32,0% |
| 3 | Обязательные резервы в иностранной валюте, размещенные в НБМ | 3.952.347.423 | 3.929.222.937 | 7,7% |
| 4 | Регулирования и скидки на потери от обесценения | -4.233.832.865 | -4.093.503.894 | -8,0% |
| 5 | Прочие балансовые активы в иностранной валюте (A1-1-2-3-4) | 20.876.473.166 | 20.664.135.253 | 40,4% |
| A.2 | Всего условных (внебалансовых) активов в иностранной валюте | 952.936.353 | 1.049.893.955 | 2,1% |
| | в т.ч. по категориям | | | |
| 1 | Покупки по срочным сделкам в иностранной валюте | 420.031.788 | 520.921.650 | 1,0% |
| 2 | Прочие условные активы в иностранной валюте | 532.904.565 | 528.972.304 | 1,1% |
| A.3 | Всего активов, привязанных к курсу иностранной валюты | 1.202.854.412 | 1.164.154.600 | 2,2% |

| | | | | | |
|-------|---|--|----------------|----------------|--------|
| | в т.ч.по категориям | | | | |
| 1 | Привязанные предоставленные кредиты | | 1.258.892.763 | 1.217.661.701 | 2,3% |
| 2 | Регулирования и скидки на потери от обесценения | | -65.804.271 | -63.259.571 | -0,1% |
| 3 | Прочие привязанные активы | | 9.765.920 | 9.752.469 | 0,0% |
| B. | Всего валютных обязательств (B.1+B.2+B.3) | | 44.491.502.427 | 44.528.386.076 | 100,0% |
| | Всего балансовых валютных обязательств (B.1+B.3) | | 43.125.169.336 | 43.087.631.657 | 96,8% |
| B.1 | Всего балансовых обязательств в иностранной валюте (исключая регулируемую статью) | | 43.125.169.336 | 43.087.630.924 | 96,8% |
| | в т.ч.по категориям | | | | |
| 1 | Счета «Лоро» в иностранной валюте иностранных банков | | 18.450.238 | 16.424.454 | 0,0% |
| 2 | Срочные депозиты в иностранной валюте иностранных банков | | 472.054.450 | 476.082.264 | 1,1% |
| 3 | Текущие счета клиентов в иностранной валюте | | 6.664.611.175 | 6.923.177.748 | 15,6% |
| 4 | Срочные депозиты клиентов в иностранной валюте | | 17.454.598.321 | 17.232.286.280 | 38,7% |
| 5 | Прочие депозиты клиентов в иностранной валюте | | 3.670.731.304 | 3.513.822.268 | 7,9% |
| 6 | Кредиты, полученные в иностранной валюте | | 4.594.654.686 | 4.691.361.646 | 10,5% |
| 8 | Регулирования | | -10.740.603 | -12.031.456 | 0,0% |
| 7 | Прочие балансовые обязательства в иностранной валюте (B1-1-2-3-4-5-6-7) | | 10.260.809.765 | 10.246.507.720 | 23,0% |
| B.2 | Всего условных (внебалансовых) обязательств в иностранной валюте | | 1.366.333.091 | 1.440.754.419 | 3,2% |
| | в т.ч.по категориям | | | | |
| 1 | Продажи по срочным сделкам в иностранной валюте | | 601.680.177 | 657.811.426 | 1,5% |
| 2 | Прочие условные обязательства в иностранной валюте | | 764.652.914 | 782.942.993 | 1,7% |
| B.3 | Всего обязательств, привязанных к курсу иностранной валюты | | 0 | 733 | 0,0% |
| | в т.ч.по категориям | | | | |
| 1 | Привязанные полученные кредиты | | 0 | 0 | 0,0% |
| 2 | Прочие привязанные обязательства | | 0 | 733 | 0,0% |
| C. | Величина открытой валютной позиции | | | | |
| 1 | Длинной* | | 7.191.628.226 | 6.787.530.833 | 100,0% |
| (i) | Евро | | 3.610.282.798 | 3.348.566.105 | 49,3% |
| (ii) | Доллары США | | 3.449.233.789 | 3.270.950.060 | 48,2% |
| (iii) | Российские рубли | | 112.471.766 | 141.217.868 | 2,1% |
| (iv) | Румынские леи | | 6.559.227 | 6.243.215 | 0,1% |
| (v) | Другие иностранные валюты | | 13.080.646 | 20.553.585 | 0,3% |
| 2 | Короткой** | | -145.522.625 | -196.139.066 | 100,0% |
| (i) | Евро | | -46.285.722 | -55.742.655 | 28,4% |

| | | | | |
|-------|---|---------------|---------------|-------|
| (ii) | Доллары США | -55.636.941 | -104.847.808 | 53,4% |
| (iii) | Российские рубли | -40.651.313 | -32.305.116 | 16,5% |
| (iv) | Румынские леи | -529.621 | -526.520 | 0,3% |
| (v) | Другие иностранные валюты | -2.419.028 | -2.716.967 | 1,4% |
| D. | Совокупный нормативный капитал | 9.394.933.231 | 9.323.357.897 | |
| E. | Отношение открытой валютной позиции в % | | | |
| 1 | Длинной*** | | | |
| (i) | Евро | 38,43 | 35,92 | |
| (ii) | Доллары США | 36,71 | 35,09 | |
| (iii) | Российские рубли | 1,20 | 1,51 | |
| (iv) | Румынские леи | 0,07 | 0,07 | |
| (v) | Другие иностранные валюты | 0,14 | 0,22 | |
| 2 | Короткой**** | | | |
| (i) | Евро | -0,49 | -0,60 | |
| (ii) | Доллары США | -0,59 | -1,12 | |
| (iii) | Российские рубли | -0,43 | -0,35 | |
| (iv) | Румынские леи | -0,01 | -0,01 | |
| (v) | Другие иностранные валюты | -0,03 | -0,03 | |

*Величина длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца 172.37 млн.MDL в том числе в Евро:10.48 млн.MDL; Долларах США: 131.95 млн.MDL; Российских Рублях: 20.1 млн.MDL

**Величина короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца -105.43 млн.MDL в том числе в Евро:-46.29 млн.MDL; Долларах США: -55.64 млн.MDL; Российских Рублях: -0.56 млн.MDL

***Отношение длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро: 0.13 %; Долларах США: 1.6 %; Российских Рублях: 0.24 %

****Отношение короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро:-0.56 %; Долларах США: -0.68 %; Российских 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:

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.

б) 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.

б) 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.

Vezi și

Tag-uri

[Величина открытой валютной позиции](#) ^[2]

[совокупный нормативный капитал](#) ^[3]

[валютные активы](#) ^[4]

[Валютные обязательства](#) ^[5]

Sursa URL:

<http://bnm.md/ro/node/52063>

Legături conexe:

[1] <http://bnm.md/ru/content/reglament-po-otkrytoy-valyutnoy-pozicii-banka-utverzhdenyyu-pas-nbm-no126-ot-28111997-g> [2] [http://bnm.md/ro/search?hashtags\[0\]=Величина открытой валютной позиции](http://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=Величина открытой валютной позиции) [3] [http://bnm.md/ro/search?hashtags\[0\]=совокупный нормативный капитал](http://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=совокупный нормативный капитал) [4] [http://bnm.md/ro/search?hashtags\[0\]=валютные активы](http://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=валютные активы) [5] [http://bnm.md/ro/search?hashtags\[0\]=Валютные обязательства](http://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=Валютные обязательства)