Опубликован на (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 среднемесячного остатка |
| | | на конец месяца | среднемесячный | |
| 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.

Смотрите также

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

---

Источник URL:
https://bnm.md/ru/content/valyutnye-aktivy-i-obyazatelstva-licenzirovannyh-bankov-v-mae-2015-goda

Ссылки по теме:

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