

**Оценка предстоящих изменений международных резервов и
другой ликвидности в иностранной валюте
Республики Молдова
по состоянию на 31 октября 2009**

**I. Официальные резервные активы
и другие активы в иностранной валюте
(примерная рыночная стоимость) (млн. долларов США)**

A. Официальные резервные активы	1,302.56
1) Резервы в иностранной валюте (в конвертируемых иностранных валютах)	1,296.99
а) Ценные бумаги	552.18
в том числе: эмитентов, имеющих головное отделение в стране, представляющей отчетность, но расположенных за границей	
б) Общая сумма валюты и депозитов:	744.81
i) в других национальных центральных банках, БМР и МВФ	118.71
ii) в банках, имеющих головное отделение в стране, представляющей отчетность в том числе: в расположенных за границей	
iii) в банках, имеющих головное отделение за пределами страны, представляющей отчетность	626.10
в том числе: в расположенных в стране, представляющей отчетность	
2) Резервная позиция в МВФ	0.01
3) СДР	5.56
4) Золото (включая золотые депозиты и, в соответствующих случаях, золото в своповых операциях)	
– объем в чистых тройских унциях	
5) Другие резервные активы (указать)	
– производные финансовые инструменты	
– ссуды, предоставленные небанковским учреждениям-нерезидентам	
– прочие	
B. Другие активы в иностранной валюте (указать)	
– ценные бумаги, не включаемые в официальные резервные активы	
– депозиты, не включаемые в официальные резервные активы	
– ссуды, не включаемые в официальные резервные активы	
– производные финансовые инструменты, не включаемые в официальные резервные активы	
– золото, не включаемое в официальные резервные активы	
– прочие	

**II. Заранее установленные краткосрочные чистые затраты активов
в иностранной валюте (номинальная стоимость) (млн. долларов США)**

	Всего	Разбивка по срокам погашения (остаточный срок до погашения)		
		До 1 месяца	От 1 до 3 месяцев	От 3 месяцев до 1 года
1. Ссуды, ценные бумаги и депозиты в иностранной валюте	-73.29	-2.41	-8.56	-62.32
– оттоки (–)				
Основная сумма	-55.82	-1.66	-6.62	-47.54
Проценты	-17.47	-0.75	-1.94	-14.78
– притоки (+)				
Основная сумма				
Проценты				
2. Совокупные короткие и длинные позиции по форвардам и фьючерсам в иностранных валютах по отношению к национальной валюте (включая форвардную составляющую валютных свопов)				
(a) Короткие позиции (–)				
(b) Длинные позиции (+)				
3. Прочее (указать)	-0.01	-0.01		
– оттоки, связанные с РЕПО (–)				
– притоки, связанные с обратными РЕПО (+)				
– коммерческий кредит (–)				
– коммерческий кредит (+)				
– прочая кредиторская задолженность (–)	-0.01	-0.01		
– прочая дебиторская задолженность (+)				

**III. Обусловленные краткосрочные чистые затраты активов в иностранной валюте
(номинальная стоимость) (млн. долларов США)**

	Всего	Разбивка по срокам погашения (остаточный срок до погашения)		
		До 1 месяца	От 1 до 3 месяцев	От 3 месяцев до 1 года
1. Условные обязательства в иностранной валюте	-117.36	-115.07		-2.29
(а) Гарантии с залоговым обеспечением со сроком погашения, наступающим в течение 1 года	-2.29			-2.29
(б) Другие условные обязательства	-115.07	-115.07		
2. Ценные бумаги в ин. валюте, выпущенные с встроенными опционами (облигации с возможностью досрочн.погашения)				
3. Невыбранные безусловные кредитные линии, предоставленные:				
(а) другими нац. органами денежно-кредитн. регулирования, БМР, МВФ и другими международными организациями				
– другими нац. органами денежно-кредитн. регулир. (+)				
– БМР (+)				
– МВФ (+)				
– другими международными организациями (+)				
(б) банками и другими фин. учрежд., имеющими головное отделение в стране, представляющей отчетность (+)				
(с) банками и др. фин. учреждениями, имеющими головное отделение за пределами страны, представл. отчетность (+)				
4. Невыбранные безусловные кредитные линии, предоставленные:				
(а) другим нац. органам денежно-кредитного регулирования, БМР, МВФ и другим международным организациям				
– другим нац. органам денежно-кредитн. регулир. (-)				
– БМР (-)				
– МВФ (-)				
– другим международным организациям (-)				



(b) банкам и другим фин. учреждениям, имеющим головное отделение в стране, представляющей отчетность (-)				
(c) банкам и другим фин. учреждениям, имеющим головное отделение за пределами страны, представл. отчетность (-)				
5. Агрегированные короткие и длинные позиции по опционам в иностранных валютах по отношению к нац. Валюте				
(a) Короткие позиции				
(i) Приобретенные опционы «пут»				
(ii) Проданные опционы «колл»				
(b) Длинные позиции				
(i) Приобретенные опционы «колл»				
(ii) Проданные опционы «пут»				
СПРАВОЧНАЯ ИНФОРМАЦИЯ. Опционы «в деньгах»				
(1) При текущих обменных курсах				
(a) Короткая позиция				
(b) Длинная позиция				
(2) +5% (снижение курса на 5%)				
(a) Короткая позиция				
(b) Длинная позиция				
(3) -5% (повышение курса на 5%)				
(a) Короткая позиция				
(b) Длинная позиция				
(4) +10% (снижение курса на 10%)				
(a) Короткая позиция				
(b) Длинная позиция				
(5) -10% (повышение курса на 10%)				
(a) Короткая позиция				
(b) Длинная позиция				
(6) Прочее (указать)				
(a) Короткая позиция				
(b) Длинная позиция				

IV. Справочные статьи (млн. долларов США)

1) Данные, подлежащие представлению со стандартной периодичностью и в стандартные сроки:	
а) краткосрочные долговые обязательства в национальной валюте, индексируемые по обменному курсу	
б) финансовые инструменты, выраженные в ин. валюте, расчеты по которым производятся в иной форме (например, в нац. валюте)	
– производные инструменты (форвардные, фьючерсные или опционные контракты)	
– короткие позиции	
– длинные позиции	
– другие инструменты	
с) активы, предоставленные в залог	
– включаемые в резервные активы	
– включаемые в другие активы в иностранной валюте	
д) ц.б., предоставленные в ссуду и проданные по соглашениям РЕПО	
– предоставленные в ссуду или проданные по соглашениям РЕПО и включенные в раздел I	
– предоставленные в ссуду или проданные по соглашениям РЕПО, но не включенные в раздел I	
– взятые в ссуду или приобретенные и включенные в раздел I	
– взятые в ссуду или приобретенные, но не включенные в раздел I	
е) активы в форме производных финансовых инструментов (чистая стоимость в текущих рыночных ценах)	
– форварды	
– фьючерсы	
– свопы	
– опционы	
– другие	
ф) производные инструменты (форвардные, фьючерсные или опционные контракты) с остаточным сроком до погашения свыше одного года, по которым требуются гарантийные депозиты	
– агрегированные короткие и длинные позиции по форвардам и фьючерсам в ин. валютах по отношению к нац. валюте (включая форвардную составляющую валютных свопов)	
(а) короткие позиции (–)	
(б) длинные позиции (+)	
– агрегированные короткие и длинные позиции по опционам в иностранных валютах по отношению к нац. валюте	
(а) короткие позиции	
(i) приобретенные опционы «пут»	
(ii) проданные опционы «колл»	
(б) длинные позиции	
(i) приобретенные опционы «колл»	
(ii) проданные опционы «пут»	
(2) Данные, раскрываемые с меньшей периодичностью	
(а) валютная структура резервов (по группам валют)	1,302.56
– валюты, входящие в корзину СДР	1,273.29
– валюты, не входящие в корзину СДР	29.27
– по отдельным валютам (факультативно)	