

## Оценка предстоящих изменений международных резервов и другой ликвидности в иностранной валюте

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

31 марта 2008

A. Официальные резервные активы	1,424.29
1) Резервы в иностранной валюте (в конвертируемых иностранных валютах)	1,423.06
а) Ценные бумаги	321.30
в том числе: эмитентов, имеющих головное отделение в Молдове, но расположенных за границей	
б) Общая сумма валюты и депозитов:	1,101.76
і) в других национальных центральных банках, БМР и МВФ	392.58
іі) в банках, имеющих головное отделение в Молдове	
в том числе: в расположенных за границей	
ііі) в банках, имеющих головное отделение за пределами страны	709.18
в том числе: в расположенных в Молдове	
2) Резервная позиция в МВФ	0.01
3) СДР	1.22
4) Монетарное золото	
– 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	-103.51	-30.55	-3.35	-69.61
– оттоки (–)				
Основная сумма	-81.95	-27.57	-2.19	-52.19
Проценты	-21.56	-2.98	-1.16	-17.42
– 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)	-0.08	-0.08		
—оттоки, связанные с РЕПО (–)				
—притоки, связанные с обратными РЕПО (+)				
—коммерческий кредит (–)				
—коммерческий кредит (+)				
—прочая кредиторская задолженность (–)	-0.08	-0.08		
—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 мес.	От 1 до 3 мес.	От 3 мес. до 1 года
1. Условные обязательства в иностранной валюте	-190.60	-188.32		-2.28
(a) Гарантии с залоговым обеспечением со сроком погашения, наступающим в течение 1 года	-3.44	-1.16		-2.28
(b) Другие условные обязательства	-187.16	-187.16		
2. Ценные бумаги в ин. валюте, выпущенные с встроенными опционами (облигации с возможностью досрочн.погашения)				
3. Невыбранные безуслов. кредитн. линии, предоставленные:				
(a) другими нац. органами денежно-кредитн. регулирования, БМР, МВФ и другими международными организациями				
– другими нац. органами денежно-кредитн. регулир. (+)				
– БМР (+)				
– МВФ (+)				
(b) банками и другими фин. учрежд., имеющими головное отделение в Молдове (+)				
(c) банками и др. фин. учреждениями, имеющими головное отделение за пределами страны (+)				
Невыбранные безусловные кредитные линии, предоставл.:				
(a) другим нац. органам денежно-кредитного регулирования, БМР, МВФ и другим международным организациям				
– другим нац. органам денежно-кредитн. регулир. (-)				
– БМР (-)				
– МВФ (-)				
(b) банкам и другим фин. учреждениям, имеющим головное отделение в Молдове (-)				



(с) банкам и другим фин. учреждениям, имеющим головное отделение за пределами страны (-)				
4. 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»				
<b>СПРАВОЧНАЯ ИНФОРМАЦИЯ. Опционы «в деньгах»</b>				
(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:	
a) краткосрочные долговые обязательства в национальной валюте, индексируемые по обменному курсу	
b) финансовые инструменты, выраженные в иностранной валюте, расчеты по которым производятся в иной форме (например, в национальной валюте)	
– форварды без фактической поставки	
– короткие позиции	
– длинные позиции	
– другие инструменты	
c) активы, предоставленные в залог	
– включаемые в резервные активы	
– включаемые в другие активы в иностранной валюте	
d) ценн. бум., 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	
e) активы в форме произв. фин. INSTR. (чистая стоимость в тек. рын. ценах)	
– форварды	
– фьючерсы	
– свопы	
– опционы	
– другие	
f) произв. INSTR. (форв., фьюч. или опц. контракты) с остаточным сроком до погашения свыше 1 года, по которым требуются гарантийные депозиты	
– агрег. короткие и длинные позиции по форв. и фьюч. в иностр. валютах по отношению к нац. валюте (вкл. форвардную составляющую вал. свопов)	
(a) короткие позиции (–)	
(b) длинные позиции (+)	
– 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»	
(2) Данные, раскрываемые с меньшей периодичностью:	
(a) валютная структура резервов (по группам валют)	1424.29
– валюты, входящие в корзину СДР	1424.28
– валюты, не входящие в корзину СДР	0.01
– по отдельным валютам (факультативно)	