

05.02.2015

Валютные активы и обязательства лицензированных банков

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] (утвержденным Постановлением Административного совета Национального банка Молдовы №126 от 28 ноября 1997г.).

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.

Статистика [2]

Tags

валютная позиция [3]

балансовые активы [4]

балансовые обязательства [5]

депозиты в иностранной валюте [6]

кредиты в иностранной валюте [7]

отношение валютной позиций [8]

Source URL:

<http://www.bnm.md/en/node/50038>

Related links:

[1] <http://www.bnm.md/ru/content/reglament-po-otkrytoy-valyutnoy-pozicii-banka-utverzhdennyj-pas-nbm-no126-ot-28111997-g> [2] <http://www.bnm.md/bdi/pages/reports/dovre/DOVRE4.xhtml?id=0&lang=ru> [3] [http://www.bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=валютная позиция](http://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=валютная%20позиция) [4] [http://www.bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=балансовые активы](http://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=балансовые%20активы) [5] [http://www.bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=балансовые обязательства](http://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=балансовые%20обязательства) [6] [http://www.bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=депозиты в иностранной валюте](http://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=депозиты%20в%20иностранной%20валюте) [7] [http://www.bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=кредиты в иностранной валюте](http://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=кредиты%20в%20иностранной%20валюте) [8] [http://www.bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=отношение валютной позиций](http://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=отношение%20валютной%20позиций)