Published on (https://www.bnm.md)

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 регулирующую 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 регулирующую 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%

	иностранной валюте (B1-1-2-3-4-5-6-7)			
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****			

2	Короткои****			
(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; Росийских 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; Росийских 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 %; Росийских 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 %; 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.

See also

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

Source URL:
https://www.bnm.md/en/node/52063

Related links:

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

https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=Валютные обязательства