Опубликован на (https://www.bnm.md)



25.04.2015

# Валютные активы и обязательства лицензированных банков в марте 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) | 52.748.728.394 | 53.798.488.439 | 100,0% |
| | Всего балансовых валютных активов (A.1+A.3) | 51.514.955.079 | 52.945.435.776 | 98,4% |
| A.1 | Всего балансовых активов в иностранной валюте (исключая регулирующую статью) | 50.304.010.935 | 51.752.626.902 | 96,2% |
| | в т.ч.по категориям | | | |
| 1 | Ликвидные активы в иностранной валюте | 12.446.359.700 | 12.923.200.448 | 24,0% |
| (i) | Наличность | 1.480.275.481 | 1.470.428.572 | 2,7% |
| (ii) | Счета «Ностро», открытые за границей | 9.071.365.604 | 9.859.107.519 | 18,3% |
| (iii) | Размещения за границей лицензированных банков | 972.037.300 | 956.031.839 | 1,8% |
| (iv) | Кредиты овернайт и средства, размещенные овернайт | 905.029.063 | 614.276.964 | 1,1% |
| (v) | Ценные бумаги | 17.652.252 | 23.355.553 | 0,1% |
| 2 | Кредиты, предоставленные в иностранной валюте | 16.775.151.226 | 16.987.061.029 | 31,6% |
| 3 | Обязательные резервы в иностранной валюте, размещенные в НБМ | 3.962.300.251 | 4.106.862.011 | 7,6% |
| 4 | Регулирования и скидки на потери от обесценения | -3.908.886.653 | -3.613.651.369 | -6,7% |
| 5 | Прочие балансовые активы в | 21.029.086.411 | 21.349.154.782 | 39,7% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | иностранной валюте (A1-1-2-3-4) | 21.629.080.411 | 21.549.154.762 | 39,7% |
| A.2 | Всего условных (внебалансовых) активов в иностранной валюте | 1.233.773.315 | 853.052.662 | 1,6% |
| | в т.ч.по категориям | | | |
| 1 | Покупки по срочным сделкам в иностранной валюте | 412.544.837 | 306.416.238 | 0,6% |
| 2 | Прочие условные активы в иностранной валюте | 821.228.478 | 546.636.424 | 1,0% |
| A.3 | Всего активов, привязанных к курсу иностранной валюты | 1.210.944.144 | 1.192.808.875 | 2,2% |
| | в т.ч.по категориям | | | |
| 1 | Привязанные предоставленные кредиты | 1.267.558.002 | 1.247.932.276 | 2,3% |
| 2 | Регулирования и скидки на потери от обесценения | -66.369.519 | -64.915.974 | 0,1% |
| 3 | Прочие привязанные активы | 9.755.661 | 9.792.572 | 0,0% |
| B. | Всего валютных обязательств (B.1+B.2+B.3) | 45.731.492.627 | 47.130.107.332 | 100,0% |
| | Всего балансовых валютных обязательств (B.1+B.3) | 44.276.572.967 | 45.880.968.101 | 97,3% |
| B.1 | Всего балансовых обязательств в иностранной валюте (исключая регулирующую статью) | 44.276.572.967 | 45.880.958.998 | 97,3% |
| | в т.ч.по категориям | | | |
| 1 | Счета «Лоро» в иностранной валюте иностранных банков | 17.384.714 | 17.337.984 | 0,0% |
| 2 | Срочные депозиты в иностранной валюте иностранных банков | 496.957.140 | 502.339.765 | 1,1% |
| 3 | Текущие счета клиентов в иностранной валюте | 7.216.294.531 | 7.812.331.863 | 16,6% |
| 4 | Срочные депозиты клиентов в иностранной валюте | 17.631.237.379 | 17.978.745.200 | 38,1% |
| 5 | Прочие депозиты клиентов в иностранной валюте | 3.515.255.755 | 3.543.916.221 | 7,5% |
| 6 | Кредиты, полученные в иностранной валюте | 4.957.549.507 | 5.059.106.521 | 10,7% |
| 8 | Регулирования | -12.725.318 | -13.199.126 | 0,0% |
| 7 | Прочие балансовые обязательства в иностранной валюте (B1-1-2-3-4-5-6-7) | 10.454.619.259 | 10.980.380.569 | 23,3% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| B.2 | Всего условных (внебалансовых) обязательств в иностранной валюте | 1.454.919.660 | 1.249.139.232 | 2,7% |
| | в т.ч.по категориям | | | |
| 1 | Продажи по срочным сделкам в иностранной валюте | 633.973.766 | 654.671.917 | 1,4% |
| 2 | Прочие условные обязательства в иностранной валюте | 820.945.894 | 594.467.315 | 1,3% |
| B.3 | Всего обязательств, привязанных к курсу иностранной валюты | 0 | 9.103 | 0,0% |
| | в т.ч.по категориям | | | |
| 1 | Привязанные полученные кредиты | 0 | 0 | 0,0% |
| 2 | Прочие привязанные обязательства | 0 | 9.103 | 0,0% |
| C. | Величина открытой валютной позиции | | | |
| 1 | Длинной* | 7.088.294.271 | 6.769.122.683 | 100,0% |
| (i) | Евро | 3.565.390.531 | 3.463.798.320 | 51,2% |
| (ii) | Доллары США | 3.445.546.602 | 3.162.772.434 | 46,7% |
| (iii) | Российские рубли | 55.465.198 | 106.521.542 | 1,6% |
| (iv) | Румынские леи | 5.693.686 | 5.253.822 | 0,1% |
| (v) | Другие иностранные валюты | 16.198.254 | 30.776.565 | 0,4% |
| 2 | Короткой** | -71.058.490 | -100.740.730 | 100,0% |
| (i) | Евро | -12.387.017 | -22.552.390 | 22,4% |
| (ii) | Доллары США | -12.438.204 | -33.949.575 | 33,7% |
| (iii) | Российские рубли | -42.618.461 | -42.828.094 | 42,5% |
| (iv) | Румынские леи | -181.646 | -209.748 | 0,2% |
| (v) | Другие иностранные валюты | -3.433.162 | -1.200.923 | 1,2% |
| D. | Совокупный нормативный капитал | 9.211.232.219 | 9.187.590.985 | |
| E. | Отношение открытой валютной позиции в % | | | |
| 1 | Длинной*** | | | |
| (i) | Евро | 38,71 | 37,70 | |
| (ii) | Доллары США | 37,41 | 34,42 | |
| (iii) | Российские рубли | 0,60 | 1,16 | |
| (iv) | Румынские леи | 0,06 | 0,06 | |
| (v) | Другие иностранные валюты | 0,18 | 0,34 | |
| 2 | Короткой**** | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| (i) | | Евро | -0,13 | -0,25 | |
| (ii) | | Доллары США | -0,14 | -0,37 | |
| (iii) | | Российские рубли | -0,46 | -0,47 | |
| (iv) | | Румынские леи | 0,00 | 0,00 | |
| (v) | | Другие иностранные валюты | -0,04 | -0,01 | |

**Величина длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца 400,87 млн.MDL в том числе в Евро:78,47 млн.MDL; Долларах США: 277,61 млн.MDL; Росийских Рублях: 30,98 млн.MDL

**Величина короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца -28,44 млн.MDL в том числе в Евро:-12,39 млн.MDL; Долларах США: -12,44 млн.MDL; Росийских Рублях: 0 млн.MDL

***Отношение длинной открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро: 0,97 %; Долларах США: 3,45 %; Росийских Рублях: 0,38 %

****Отношение короткой открытой валютной позиции, исключая Banca de Economii, Banca Socială и Unibank составила к концу месяца в Евро:-0,15 %; Долларах США: -0,15 %; Росийских Рублях: 0 %

---

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:

а)*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:

а)*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 УРЛ:
https://www.bnm.md/ru/content/valyutnye-aktivy-i-obyazatelstva-licenzirovannyh-bankov-v-marte-2015-goda

Ссылки по теме:

[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/ru/search?hashtags[0]=Величина открытой валютной позиции [3] https://www.bnm.md/ru/search?hashtags[0]=совокупный нормативный капитал [4] https://www.bnm.md/ru/search?hashtags[0]=валютные активы [5] https://www.bnm.md/ru/search?hashtags[0]=Валютные обязательства