XARİCİ VALYUTA İLƏ BAĞLI RİSKİN QARŞISININ ALINMASI MƏQSƏDİ İLƏ İSTİFADƏ EDİLƏN ALƏTLƏRİN (HECİNQ ALƏTLƏRİ) SİYAHISI

Forvard – gələcəkdə razılaşdırılmış qiymətə maliyyə aktivlərinin alınması və ya satılması ilə bağlı öhdəlik ehtiva edən, həmçinin tərəflər arasında birjadan kənar bağlanan müqavilə növü hesab olunur. Bank, bəzi maliyyə institutları ilə valyuta riskini minimallaşdırmaq məqsədilə **NDF** (Non-Deliverable Forward) müqavilələri üzrə əməliyyatlar həyata keçirir. NDF müqaviləsi konvertasiya olunmayan valyutanın razılaşdırılmış məbləğini, çatdırılma tarixini və forvard məzənnəsini özündə əks etdirir. Qeyd etmək lazımdır ki, bu tip əməliyyatlar yalnız ISDA Master Agreement (International Swaps and Derivatives Association) müqavilələri çərçivəsində həyata keçirilməkdədir.

NDS (Non-Deliverable Swaps) – Ödəmə müddətinə qədər razılaşdırılmış şərti məbləğə sabit və üzən faiz dərəcəsi tətbiq edilməklə, təhvil verilməyən valyuta ilə pul vəsaitlərinin hərəkətini mübadilə etmək üçün qarşı tərəflər arasında razılaşma şəkli hesab edilir. Bu struktur tərəflərə qısamüddətli likvidlik ehtiyaclarını idarə etməyə və həmçinin gələcək valyuta riskindən hedcinq etməyə imkan verir.

Svop – razılıq əsasında A (alıcı) əvvəlcədən müəyyənləşdirilmiş gündə B (satıcı) tərəfdən hər hansısa maliyyə alətini tərəflər arasında razılaşdırılmış qiymətə alır və əvvəlcədən müəyyənləşdirilmiş digər vaxtda və qiymət səviyyəsində qarşı tərəfə geri satmağı həyata keçirir. Hər iki tərəf gələcəkdə yarana biləcək potensial riskləri və bundan irəli gələn mümkün qiymət dəyişikliklərinə məruz qalmadan müqavilə əsasında razılaşdırılmış qiymətlərlə əməliyyatları həyata keçirməkdədirlər. Həmçinin Bank, kontragentlə razılıq çərçivəsində depo-svop (depozit təminatlı svoplar) əməliyyatları həyata keçirərək, xarici valyutada olan aktivlər (qiymətli kağızlar və ya təminat qismində yer alan digər aktivlərlə həyata keçirilə bilər) üzrə itkiləri minimallaşdırmaqdadır.

Valyutalararası Hedcing – Forex platforması vasitəsilə qısamüddətli balansarxası maddələrdə yer alan, həmçinin satış üzrə öhdəlik hesab edilən və daha sonradan eyni məbləğdə digər valyuta alışı üzrə satışını həyata keçirən törəmə alət vasitələrindən hesab edilir. Əsasən USD-EUR valyuta cütlükləri arasında baş verməkdədir.