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

23.06.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna mai 2015

(lei moldovenești)		Datele, inclusiv cu activele şi obligaţiunile ataşate la cursul valutei străine		
		Sold		Ponderea mediei lunare
		la sfîrşitul lunii	mediu lunar	
A.	Total active valutare (A.1+A.2+A.3)	51,601,617,412	52,208,987,683	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	50,718,564,272	51,086,569,507	97.9%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	49,510,721,114	49,884,038,927	95.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	12,078,523,012	12,391,250,759	23.7%
(i)	Numerar	1,547,720,909	1,598,957,583	3.1%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	8,370,501,225	8,809,102,547	16.9%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,261,295,878	1,334,357,285	2.5%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	880,128,118	629,553,579	1.2%
(v)	Valori mobiliare	18,876,882	19,279,764	0.0%
2	Credite acordate în valută străină	17,019,459,741	16,915,115,618	32.4%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,929,649,966	3,961,062,984	7.6%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-4,232,556,654	-4,245,402,937	-8.1%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	20,715,645,049	20,862,012,503	40.0%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	883,053,140	1,122,418,176	2.1%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	302,558,289	313,014,681	0.6%
2	Alte active condiţionale în valută străină	580,494,851	809,403,495	1.5%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,207,843,158	1,202,530,580	2.3%
	inclusiv pe categorii			

1	Credite acordate ataşate	1,264,568,856	1,257,797,342	2.4%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-66,483,984	-65,387,728	-0.1%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	9,758,286	10,120,966	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	43,748,495,694	44,651,322,606	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	42,458,304,785	43,122,234,779	96.6%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	42,458,304,785	43,122,234,779	96.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	16,949,805	16,758,854	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	470,306,880	471,138,181	1.0%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	6,914,762,607	7,000,405,311	15.7%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	16,704,701,850	17,137,540,312	38.4%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,714,417,045	3,695,911,546	8.3%
6	Credite primite în valută străină	4,442,377,407	4,542,328,920	10.2%
7	Ajustări	-10,337,705	-10,621,349	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	10,205,126,896	10,268,773,003	23.0%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	1,290,190,909	1,529,087,827	3.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	624,940,012	614,275,124	1.4%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	665,250,897	914,812,703	2.0%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	0	0	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	0	0	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi*	7,984,879,167	7,723,883,373	100.0%
(i)	Euro	3,858,715,555	3,817,750,248	49.4%
(ii)	Dolari SUA	3,982,231,937	3,736,992,402	48.4%
(iii)	Ruble ruseşti	112,469,933	129,100,386	1.7%
(iv)	Lei româneşti	9,605,385	8,649,182	0.1%
(v)	Alte valute străine	21,856,357	31,391,154	0.4%

2	Scurte**	-131,904,187	-166,369,052	100.0%
(i)	Euro	-100,345,787	-71,216,391	42.8%
(ii)	Dolari SUA	-6,488,025	-58,304,565	35.1%
(iii)	Ruble ruseşti	-21,382,977	-34,813,659	20.9%
(iv)	Lei româneşti	-468,998	-199,954	0.1%
(v)	Alte valute străine	-3,218,400	-1,834,483	1.1%
D.	Capital normativ total	9,543,543,959	9,515,947,301	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi***			
(i)	Euro	40.43	40.12	
(ii)	Dolari SUA	41.73	39.27	
(iii)	Ruble ruseşti	1.18	1.36	
(iv)	Lei româneşti	0.10	0.09	
(v)	Alte valute străine	0.23	0.33	
2	Scurte****			
(i)	Euro	-1.05	-0.75	
(ii)	Dolari SUA	-0.07	-0.61	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.22	-0.37	
(iv)	Lei româneşti	0.00	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.03	-0.02	

*Mărimea poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei 188.17 mil.MDL, dintre care în Euro: 7.27 mil.MDL; Dolari SUA: 137.99 mil.MDL; Ruble rusești: 23.36 mil.MDL

**Mărimea poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei -111.62 mil.MDL, dintre care în Euro: -100.35 mil.MDL; Dolari SUA: -6.49 mil.MDL; Ruble rusești: -1.1 mil.MDL

***Raportul poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: 0.09 %; Dolari SUA: 1.64 %; Ruble rusești:0.28 %

****Raportul poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: -1.19 %; Dolari SUA: -0.08 %; Ruble rusești:-0.01 %

Statistica [1]

Informaţia privind activele şi obligaţiunile valutare ale băncilor licenţiate este întocmită în baza rapoartelor

privind poziţia valutară deschisă a băncii, prezentate de către băncile licenţiate în conformitate cu Regulamentul privind poziţia valutară deschisă a băncii [2] (aprobat prin Hotărîrea Consiliului de administraţie al Băncii Naţionale a Moldovei nr. 126 din 28 noiembrie 1997).

Informaţia publicată conţine date agregate privind activele şi obligaţiunile valutare ale băncilor licenţiate, mărimea poziţiei valutare deschise, capitalul normativ total, raportul poziţiei valutare deschise.

Informaţia privind activele şi obligaţiunile valutare ale băncilor licenţiate este prezentată după cum urmează:

1) active valutare, care includ:

a) *activele valutare bilanţiere*:

- activele bilanţiere în valută străină – numerarul, mijloacele în conturile "Nostro" deschise în străinătate, plasările în străinătate ale băncilor licenţiate, mijloacele plasate şi creditele overnight, valorile mobiliare, creditele acordate, rezervele obligatorii plasate în BNM, alte active bilanţiere în valută străină;
- activele în lei moldoveneşti ataşate la cursul valutei străine – creditele acordate ataşate şi alte active ataşate;

b) *activele condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)* – cumpărările la operaţiunile la termen în valută străină şi alte active condiţionale în valută străină.

2) obligaţiuni valutare, care includ:

a) *obligaţiunile valutare bilanţiere*:

- obligaţiunile bilanţiere în valută străină – mijloacele în conturile „Loro" ale băncilor din străinătate, depozitele la termen ale băncilor din străinătate, conturi curente ale clienţilor, depozitele la termen ale clienţilor, depozitele diverse ale clienţilor, creditele primite, alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină;
- obligaţiunile în lei moldoveneşti ataşate la cursul valutei străine – creditele primite ataşate şi alte obligaţiuni ataşate.

b) *obligaţiunile condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)* – vînzările la operaţiunile la termen în valută străină şi alte obligaţiuni condiţionale în valută străină.Informaţia privind activele şi obligaţiunile valutare include datele privind soldurile (recalculate în dolari SUA) activelor şi obligaţiunilor valutare la sfîrşitul lunii.

Determinarea echivalentului în dolari SUA a soldurilor menţionate se efectuează cu aplicarea cursurilor oficiale ale leului moldovenesc faţă de dolarul SUA şi valuta străină respectivă valabile la sfîrşitul lunii.Mărimea poziţiei valutare deschise reprezintă diferenţa dintre suma activelor valutare într-o anumită valută străină şi suma obligaţiunilor valutare în valuta respectivă.

Informaţia privind mărimea poziţiei valutare deschise este prezentată în valoare absolută (echivalentul în dolari SUA) la sfîrşitul lunii, separat pentru valutele străine cel mai des tranzacţionate (dolarul SUA, euro, rubla rusească, leul românesc) şi pentru alte valute străine.

Raportul poziţiei valutare deschise reprezintă raportul dintre mărimea poziţiei valutare deschise şi mărimea capitalului normativ total al băncilor. Raportul poziţiei valutare deschise este prezentat în procente la sfîrşitul lunii pentru valutele străine sus-menţionate.

Informaţia privind activele şi obligaţiunile valutare ale băncilor licenţiate se publică lunar pînă în ultima zi a lunii următoare celei de raportare.

See also

Tags

raportul pozitiei valutare [3]

credite in valuta [4]

depozite in valuta [5]

active bilantiere [6]

obligatiuni bilantiere [7]

Active valutare [8]

obligaţiuni valutare [9]

poziţia valutară deschisă a băncilor [10]

obligaţiuni condiţionale [11]

Source URL:
https://www.bnm.md/en/node/52039

Related links:

[1] https://www.bnm.md/bdi/pages/reports/dovre/DOVRE4.xhtml?id=0&lang=ro [2] https://www.bnm.md/ro/content/regulamentul-cu-privire-la-pozitia-valutara-deschisa-bancii-aprobat-prin-hca-al-bnm-nr-126 [3] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=raportul pozitiei valutare [4] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=credite in valuta [5] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=depozite in valuta [6] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=active bilantiere [7] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligatiuni bilantiere [8] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=Active valutare [9] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligaţiuni valutare [10] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=poziţia valutară deschisă a băncilor [11] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligaţiuni condiţionale