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

22.07.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna iunie 2015

(lei moldovenești)		Datele, inclusiv 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)	53.014.804.945	52.938.999.665	100,0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	52.257.752.221	52.253.696.434	98,7%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	50.960.684.054	50.984.982.167	96,3%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	11.701.002.680	12.143.269.599	22,9%
(i)	Numerar	1.676.798.445	1.686.067.635	3,2%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	8.192.898.650	8.602.053.252	16,2%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1.135.646.888	1.302.609.107	2,5%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	680.404.763	533.029.821	1,0%
(v)	Valori mobiliare	15.253.934	19.509.784	0,0%
2	Credite acordate în valută străină	17.979.100.957	17.728.267.204	33,5%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	4.139.000.099	4.090.432.976	7,7%
4	Ajustări și reduceri pentru pierderi din depreciere	-4.522.077.536	-4.397.709.857	-8,3%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	21.663.657.854	21.420.722.245	40,5%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	757.052.724	685.303.232	1,3%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărări - operaţiuni la termen în valută străină	288.749.404	287.150.291	0,5%
2	Alte active condiţionale în valută străină	468.303.320	398.152.941	0,8%

A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1.297.068.167	1.268.714.267	2,4%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1.358.520.881	1.327.093.603	2,5%
2	Ajustări și reduceri pentru pierderi din depreciere	-71.469.200	-68.462.382	-0,1%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	10.016.486	10.083.046	0,0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	44.391.347.128	44.476.752.516	100,0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	43.210.187.849	43.373.241.829	97,5%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	43.210.187.849	43.373.241.792	97,5%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	16.817.004	16.944.994	0,0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	486.914.450	481.485.033	1,1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7.270.287.641	7.264.615.289	16,3%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	17.158.223.929	17.169.014.582	38,6%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3.477.290.169	3.566.123.087	8,0%
6	Credite primite în valută străină	4.146.621.551	4.346.989.502	9,8%
7	Ajustări	-10.425.533	-10.556.696	0,0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	10.664.458.638	10.538.626.001	23,7%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	1.181.159.279	1.103.510.687	2,5%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări - operaţiuni la termen în valută străină	631.778.509	626.272.319	1,4%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	549.380.770	477.238.369	1,1%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	0	37	0,0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0,0%
	Alte obligaţiuni ataşate	0	37	0,0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi*	8.770.330.450	8.628.862.803	100,0%
(i)	Euro	4.671.922.790	4.501.143.706	52,2%
(ii)	Dolari SUA	3.966.339.192	3.975.551.357	46,1%

(iii)		Ruble ruseşti	102.678.006	112.106.355	1,3%
(iv)		Lei româneşti	8.712.507	9.337.886	0,1%
(v)		Alte valute străine	20.677.955	30.723.498	0,3%
2	Scurte**		-146.865.430	-166.813.305	100,0%
(i)		Euro	-71.725.575	-93.704.470	56,2%
(ii)		Dolari SUA	-37.921.490	-31.854.173	19,1%
(iii)		Ruble ruseşti	-35.694.722	-39.469.380	23,7%
(iv)		Lei româneşti	0	-234.428	0,1%
(v)		Alte valute străine	-1.523.643	-1.550.854	0,9%
D.	Capital normativ total		9.639.044.338	9.599.419.936	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)				
1	Lungi***				
(i)		Euro	48,47	46,87	
(ii)		Dolari SUA	41,15	41,42	
(iii)		Ruble ruseşti	1,07	1,17	
(iv)		Lei româneşti	0,09	0,10	
(v)		Alte valute străine	0,21	0,32	
2	Scurte****				
(i)		Euro	-0,74	-0,98	
(ii)		Dolari SUA	-0,39	-0,33	
(iii)		Ruble ruseşti	-0,37	-0,41	
(iv)		Lei româneşti	0,00	0,00	
(v)		Alte valute străine	-0,02	-0,02	

*Mărimea poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârșitul perioadei 138,65 mil.MDL, dintre care în Euro: 15,71 mil.MDL; Dolari SUA: 95,56 mil.MDL; Ruble rusești: 10,99 mil.MDL

**Mărimea poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârșitul perioadei -116,79 mil.MDL, dintre care în Euro: -71,73 mil.MDL; Dolari SUA: -37,92 mil.MDL; Ruble rusești: -5,62 mil.MDL

***Raportul poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârșitul perioadei în Euro: 0,18 %; Dolari SUA: 1,12 %; Ruble rusești:0,13 %

****Raportul poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârșitul perioadei în Euro: -0,84 %; Dolari SUA: -0,44 %; Ruble rusești:-0,07 %

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/52132

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