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

22.09.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna august 2015

(lei moldoveneşti)		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)	53,271,265,230	52,919,171,279	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	52,726,125,065	52,300,014,991	98.8%
A.1	Total active bilanţiere în valută straină	51,399,814,184	51,006,334,714	96.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	11,234,281,435	11,467,810,867	21.7%
(i)	Numerar	2,078,981,218	1,802,077,125	3.4%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	7,021,191,027	7,769,146,753	14.7%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,309,315,563	1,255,685,877	2.4%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	802,378,746	624,645,028	1.2%
(v)	Valori mobiliare	22,414,881	16,256,084	0.0%
2	Credite acordate în valută străină	18,166,400,244	17,978,115,371	34.0%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	4,199,994,898	4,120,319,763	7.8%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-4,836,999,051	-4,663,160,528	-8.8%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	22,636,136,658	22,103,249,242	41.7%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	545,140,165	619,156,288	1.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	311,225,775	327,017,681	0.6%
2	Alte active condiţionale în valută străină	233,914,390	292,138,607	0.6%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,326,310,881	1,293,680,278	2.4%

	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,389,002,968	1,355,531,454	2.5%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-74,098,695	-72,438,440	-0.1%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,406,608	10,587,264	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	43,803,821,281	43,798,733,080	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	42,828,316,450	42,750,055,373	97.6%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	42,828,311,195	42,750,048,546	97.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	17,165,674	17,257,571	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	494,607,170	489,048,991	1.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,291,680,167	7,390,327,969	16.9%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	16,187,936,028	16,417,364,034	37.5%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,627,200,059	3,506,956,591	8.0%
6	Credite primite în valută străină	4,041,729,830	3,990,530,681	9.1%
7	Ajustări	-10,237,629	-10,132,320	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	11,178,229,896	10,948,695,029	25.0%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	975,504,831	1,048,677,707	2.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	663,432,550	672,425,427	1.5%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	312,072,281	376,252,281	0.9%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	5,255	6,827	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	5,255	6,827	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi*	9,663,621,253	9,363,746,121	100.0%
(i)	Euro	5,514,547,421	5,060,805,713	54.0%
(ii)	Dolari SUA	4,040,299,462	4,167,153,874	44.5%
(iii)	Ruble ruseşti	80,481,086	100,783,061	1.1%
(iv)	Lei româneşti	5,952,532	7,982,972	0.1%

(v)	Alte valute străine	22,340,752	27,020,500	0.3%
2	Scurte**	-196,501,827	-243,829,759	100.0%
(i)	Euro	-12,915,602	-112,241,093	46.0%
(ii)	Dolari SUA	-124,861,319	-84,278,178	34.6%
(iii)	Ruble ruseşti	-55,720,460	-43,938,723	18.0%
(iv)	Lei româneşti	-1,709,478	-1,213,316	0.5%
(v)	Alte valute străine	-1,294,968	-2,158,450	0.9%
D.	Capital normativ total	9,790,856,108	9,763,647,777	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi***			
(i)	Euro	56.32	51.83	
(ii)	Dolari SUA	41.27	42.68	
(iii)	Ruble ruseşti	0.82	1.03	
(iv)	Lei româneşti	0.06	0.08	
(v)	Alte valute străine	0.23	0.28	
2	Scurte****			
(i)	Euro	-0.13	-1.15	
(ii)	Dolari SUA	-1.28	-0.86	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.57	-0.45	
(iv)	Lei româneşti	-0.02	-0.01	
(v)	Alte valute străine	-0.01	-0.02	

*Mărimea poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei 280.69 mil.MDL, dintre care în Euro: 168.52 mil.MDL; Dolari SUA: 81.08 mil.MDL; Ruble rusești: 16.03 mil.MDL.

**Mărimea poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei -154.7 mil.MDL, dintre care în Euro: -12.92 mil.MDL; Dolari SUA: -124.86 mil.MDL; Ruble rusești: -13.92 mil.MDL

***Raportul poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: 1.95 %; Dolari SUA: 0.94 %; Ruble rusești:0.19 %.

****Raportul poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: -0.15 %; Dolari SUA: -1.45 %; Ruble rusești:-0.16 %.

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/52393

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