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

20.11.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna octombrie 2015

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna octombrie 2015 (lei moldoveneşti)*.

(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)	32,740,871,182	32,685,525,216	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	32,031,247,171	32,415,441,588	99.2%
A.1	Total active bilanţiere în valută straină	30,942,239,812	31,324,749,787	95.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	10,992,929,485	11,323,107,731	34.7%
(i)	Numerar	1,511,058,212	1,529,765,083	4.7%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	7,258,350,582	7,715,296,281	23.6%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,459,235,182	1,433,074,198	4.4%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	738,734,035	619,656,725	1.9%
(v)	Valori mobiliare	25,551,474	25,315,444	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	16,499,141,557	16,469,599,446	50.4%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,620,494,440	3,657,794,807	11.2%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-843,263,326	-843,730,021	-2.6%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	672,937,656	717,977,823	2.2%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	709,624,011	270,083,627	0.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	66,752,540	97,908,457	0.3%
2	Alte active condiţionale în valută străină	642,871,471	172,175,170	0.5%

A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,089,007,359	1,090,691,802	3.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,149,568,109	1,152,918,666	3.5%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-72,738,376	-74,010,093	-0.2%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	12,177,626	11,783,229	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	32,453,400,105	32,381,965,484	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	31,749,913,411	32,118,604,768	99.2%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	31,749,911,299	32,118,599,883	99.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	2,114,180	1,671,300	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	194,063,330	196,767,621	0.6%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	8,076,939,808	8,199,512,893	25.3%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	15,647,373,382	15,706,933,910	48.5%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,522,055,072	3,528,618,001	10.9%
6	Credite primite în valută străină	3,745,402,621	3,866,865,010	12.0%
7	Ajustări	-11,027,410	-11,294,498	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	572,990,316	629,525,647	1.9%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	703,486,694	263,360,716	0.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	66,831,429	97,647,814	0.3%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	636,655,265	165,712,902	0.5%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	2,112	4,885	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	2,112	4,885	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	376,890,816	379,707,619	100.0%
(i)	Euro	129,759,170	139,922,736	36.9%
(ii)	Dolari SUA	217,496,491	185,860,472	48.9%
(iii)	Ruble rusesti	11,977,112	27,847,252	7.3%

(iv)	Lei românești	5,074,779	5,289,213	1.4%
(v)	Alte valute străine	12,583,264	20,787,945	5.5%
2	Scurte	-89,419,724	-76,049,468	100.0%
(i)	Euro	-65,215,030	-40,881,404	53.8%
(ii)	Dolari SUA	-2,027,930	-19,074,347	25.1%
(iii)	Ruble ruseşti	-12,853,043	-7,402,534	9.7%
(iv)	Lei românești	-487,684	-172,704	0.2%
(v)	Alte valute străine	-8,836,037	-8,518,479	11.2%
D.	Capital normativ total	8,897,148,564	8,846,439,890	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	1.46	1.58	
(ii)	Dolari SUA	2.44	2.10	
(iii)	Ruble ruseşti	0.13	0.31	
(iv)	Lei românești	0.06	0.06	
(v)	Alte valute străine	0.14	0.23	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.73	-0.46	
(ii)	Dolari SUA	-0.02	-0.22	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.14	-0.08	
(iv)	Lei românești	-0.01	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.10	-0.10	

*informația nu include datele BC Banca de Economii SA, BC Banca Socială SA și BC Unibank SA care din 16.10.2015 se află în proces de lichidare silită

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/52788

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