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

22.01.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna decembrie 2015

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna decembrie 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)	33,740,393,639	31,035,328,370	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	30,395,595,184	30,706,632,373	99.0%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	29,374,958,850	29,660,753,952	95.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	10,286,377,293	10,125,581,322	32.6%
(i)	Numerar	1,516,807,977	1,515,895,209	4.9%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	6,901,198,812	6,987,075,850	22.5%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,029,855,498	1,086,019,101	3.5%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	814,365,158	510,778,531	1.6%
(v)	Valori mobiliare	24,149,848	25,812,632	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	15,857,042,570	16,201,662,033	52.2%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,560,597,717	3,594,959,851	11.6%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-898,792,201	-966,285,988	-3.1%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	569,733,471	704,836,733	2.3%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	3,344,798,455	328,695,997	1.0%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	34,364,640	49,745,627	0.1%

	străină			
2	Alte active condiţionale în valută străină	3,310,433,815	278,950,370	0.9%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,020,636,334	1,045,878,421	3.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,098,681,901	1,107,348,016	3.6%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-89,867,549	-73,238,308	-0.2%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,821,982	11,768,714	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	33,588,997,079	30,738,744,913	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	30,250,741,768	30,413,724,845	98.9%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	30,250,740,203	30,413,721,815	98.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	2,440,381	1,990,813	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	51,127,170	63,858,800	0.2%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,809,446,668	7,621,783,992	24.8%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	15,005,805,669	15,221,551,498	49.5%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,373,149,358	3,398,710,036	11.0%
6	Credite primite în valută străină	3,523,522,185	3,535,366,431	11.5%
7	Ajustări	-10,290,116	-10,506,144	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	495,538,888	580,966,389	1.9%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	3,338,255,311	325,020,067	1.1%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	34,362,842	52,794,187	0.2%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	3,303,892,469	272,225,880	0.9%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	1,565	3,031	0.0%
	inclusiv pe categorii			

	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	1,565	3,031	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	312,272,597	373,110,296	100.0%
(i)	Euro	14,195,414	78,121,718	20.9%
(ii)	Dolari SUA	227,147,209	249,710,057	66.9%
(iii)	Ruble ruseşti	38,137,889	19,018,602	5.1%
(iv)	Lei româneşti	7,936,343	7,037,959	1.9%
(v)	Alte valute străine	24,855,742	19,221,961	5.2%
2	Scurte	-160,905,744	-77,748,009	100.0%
(i)	Euro	-125,054,014	-50,640,454	65.1%
(ii)	Dolari SUA	-10,392,416	-13,312,746	17.1%
(iii)	Ruble ruseşti	-16,455,497	-4,961,774	6.4%
(iv)	Lei româneşti	-1,062,022	-131,076	0.2%
(v)	Alte valute străine	-7,941,795	-8,701,960	11.2%
D.	Capital normativ total	9,140,893,757	9,106,359,354	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	0.16	0.86	
(ii)	Dolari SUA	2.48	2.74	
(iii)	Ruble ruseşti	0.42	0.21	
(iv)	Lei româneşti	0.09	0.08	
(v)	Alte valute străine	0.27	0.21	
2	Scurte			
(i)	Euro	-1.37	-0.56	
(ii)	Dolari SUA	-0.11	-0.15	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.18	-0.05	
(iv)	Lei româneşti	-0.01	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.09	-0.10	

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/53483

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