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

22.02.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna ianuarie 2016

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna ianuarie 2016 (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)	32,770,288,190	32,546,941,728	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	31,871,114,427	31,641,646,335	97.2%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	30,820,143,094	30,589,884,281	94.0%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	11,003,893,525	10,872,497,129	33.4%
(i)	Numerar	1,619,962,161	1,657,588,643	5.1%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	7,478,254,228	7,553,663,411	23.2%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,152,350,968	1,103,310,459	3.4%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	730,537,365	533,247,073	1.6%
(v)	Valori mobiliare	22,788,803	24,687,543	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	16,428,261,787	16,317,196,983	50.1%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,702,785,358	3,670,017,614	11.3%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,135,283,795	-1,031,026,065	-3.1%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	820,486,219	761,198,620	2.3%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	899,173,763	905,295,393	2.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	96,373,675	94,555,198	0.3%

2	Alte active condiţionale în valută străină	802,800,088	810,740,195	2.5%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,050,971,333	1,051,762,054	3.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,135,735,250	1,133,114,315	3.5%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-96,617,452	-93,476,408	-0.3%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,853,535	12,124,147	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	32,367,667,294	32,262,087,632	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	31,477,192,494	31,362,863,465	97.2%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	31,477,161,787	31,362,835,100	97.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,543,115	1,880,093	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	53,558,670	52,973,254	0.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	8,236,899,401	8,203,707,257	25.4%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	15,460,074,737	15,438,701,639	47.9%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,595,034,399	3,520,608,610	10.9%
6	Credite primite în valută străină	3,540,898,554	3,577,130,741	11.1%
7	Ajustări	-11,690,240	-11,291,321	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	600,843,151	579,124,827	1.8%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	890,474,800	899,224,167	2.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	94,840,958	94,488,385	0.3%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	795,633,842	804,735,782	2.5%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	30,707	28,365	0.0%
	inclusiv pe categorii			

	Credite primite atașate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni atașate	30,707	28,365	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	461,133,534	364,590,087	100.0%
(i)	Euro	146,643,406	120,929,375	33.2%
(ii)	Dolari SUA	265,578,539	191,328,509	52.5%
(iii)	Ruble ruseşti	15,864,440	25,558,800	7.0%
(iv)	Lei românești	8,554,801	7,284,975	2.0%
(v)	Alte valute străine	24,492,348	19,488,428	5.3%
2	Scurte	-58,517,770	-79,672,725	100.0%
(i)	Euro	-6,107,787	-29,762,867	37.3%
(ii)	Dolari SUA	-25,707,551	-28,895,409	36.3%
(iii)	Ruble ruseşti	-18,706,161	-12,316,499	15.5%
(iv)	Lei românești	-466,669	-542,420	0.7%
(v)	Alte valute străine	-7,529,602	-8,155,530	10.2%
D.	Capital normativ total	9,278,649,560	9,240,128,249	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	1.58	1.31	
(ii)	Dolari SUA	2.86	2.07	
(iii)	Ruble ruseşti	0.17	0.28	
(iv)	Lei românești	0.09	0.08	
(v)	Alte valute străine	0.26	0.21	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.07	-0.32	
(ii)	Dolari SUA	-0.28	-0.31	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.20	-0.13	
(iv)	Lei românești	-0.01	-0.01	
(v)	Alte valute străine	-0.08	-0.09	

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/53564

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