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

22.03.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna februarie 2016

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna februarie 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)	31,035,756,532	31,502,036,598	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	30,668,607,274	31,223,186,300	99.1%
A.1	Total active bilanţiere în valută straină	29,639,707,240	30,185,733,611	95.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	10,316,759,235	10,709,262,087	34.0%
(i)	Numerar	1,698,984,087	1,624,276,613	5.1%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	6,774,938,331	7,233,726,699	23.0%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,098,221,823	1,197,492,410	3.8%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	722,089,524	631,185,757	2.0%
(v)	Valori mobiliare	22,525,470	22,580,609	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	15,904,911,507	16,108,688,560	51.1%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,622,658,550	3,649,963,577	11.6%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,181,039,913	-1,151,140,200	-3.7%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	976,417,861	868,959,587	2.8%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	367,149,258	278,850,298	0.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	60,901,666	58,584,620	0.2%

	străină			
2	Alte active condiţionale în valută străină	306,247,592	220,265,678	0.7%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,028,900,034	1,037,452,689	3.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,114,773,388	1,120,717,204	3.6%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-97,627,790	-94,822,057	-0.3%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,754,436	11,557,542	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	30,718,181,917	31,127,060,553	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	30,322,349,807	30,792,977,201	98.9%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	30,322,335,944	30,792,955,119	98.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,804,863	1,585,030	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	22,267,600	44,004,511	0.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,951,758,767	8,088,502,093	26.0%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	14,909,666,090	15,170,766,592	48.7%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,437,793,169	3,475,013,440	11.2%
6	Credite primite în valută străină	3,415,046,943	3,460,272,433	11.1%
7	Ajustări	-11,172,805	-11,439,070	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	595,171,317	564,250,091	1.8%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	395,832,110	334,083,352	1.1%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	94,671,899	119,440,337	0.4%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	301,160,211	214,643,015	0.7%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	13,863	22,082	0.0%
	inclusiv pe categorii			

	Credite primite atașate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni atașate	13,863	22,082	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	403,123,225	438,729,828	100.0%
(i)	Euro	79,328,880	126,616,830	28.8%
(ii)	Dolari SUA	281,933,586	276,723,518	63.1%
(iii)	Ruble ruseşti	16,984,737	8,708,358	2.0%
(iv)	Lei românești	10,244,066	10,109,348	2.3%
(v)	Alte valute străine	14,631,956	16,571,774	3.8%
2	Scurte	-85,548,599	-63,799,838	100.0%
(i)	Euro	-66,484,074	-23,716,977	37.2%
(ii)	Dolari SUA	-4,204,013	-14,874,342	23.3%
(iii)	Ruble ruseşti	-4,321,042	-13,656,700	21.4%
(iv)	Lei românești	-652,205	-203,013	0.3%
(v)	Alte valute străine	-9,887,265	-11,348,806	17.8%
D.	Capital normativ total	9,304,171,405	9,296,458,380	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	0.85	1.36	
(ii)	Dolari SUA	3.03	2.98	
(iii)	Ruble ruseşti	0.18	0.09	
(iv)	Lei românești	0.11	0.11	
(v)	Alte valute străine	0.16	0.18	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.71	-0.26	
(ii)	Dolari SUA	-0.05	-0.16	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.05	-0.15	
(iv)	Lei românești	-0.01	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.11	-0.12	

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/53615

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