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

23.05.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna aprilie 2016

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna aprilie 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)	33,804,476,925	30,592,392,162	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	29,482,767,350	29,769,978,838	97.3%
A.1	Total active bilanţiere în valută straină	28,448,669,836	28,739,360,541	93.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	9,272,407,383	9,522,474,949	31.1%
(i)	Numerar	2,471,118,351	2,115,668,830	6.9%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	5,333,904,156	5,871,877,630	19.2%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	862,491,763	909,622,706	3.0%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	579,396,625	601,323,201	1.9%
(v)	Valori mobiliare	25,496,488	23,982,583	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	16,030,960,487	16,016,882,977	52.4%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,610,474,308	3,587,532,138	11.7%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,413,356,791	-1,379,941,076	-4.5%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	948,184,449	992,411,553	3.2%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	4,321,709,575	822,413,324	2.7%
	inclusiv pe categorii			

1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	100,393,649	72,796,196	0.2%
2	Alte active condiţionale în valută străină	4,221,315,926	749,617,129	2.5%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,034,097,514	1,030,618,297	3.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,110,421,130	1,117,097,926	3.7%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-87,648,078	-98,297,065	-0.3%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,324,462	11,817,436	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	33,624,748,326	30,348,572,792	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	29,310,232,637	29,527,901,923	97.3%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	29,310,173,330	29,527,886,129	97.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	3,058,328	1,864,562	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	22,625,100	22,522,027	0.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,516,006,448	7,661,860,341	25.2%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	14,573,700,710	14,581,670,307	48.0%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,387,927,906	3,426,128,495	11.3%
6	Credite primite în valută străină	3,315,407,181	3,301,534,758	10.9%
7	Ajustări	-10,670,504	-10,809,773	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	502,118,161	543,115,412	1.8%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	4,314,515,689	820,670,869	2.7%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	100,461,085	74,047,108	0.2%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	4,214,054,604	746,623,761	2.5%

B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	59,307	15,794	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	59,307	15,794	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	274,357,139	334,380,943	100.0%
(i)	Euro	96,874,961	96,141,309	28.8%
(ii)	Dolari SUA	136,445,878	170,073,943	50.9%
(iii)	Ruble ruseşti	11,193,357	35,057,593	10.5%
(iv)	Lei româneşti	12,604,588	10,546,388	3.1%
(v)	Alte valute străine	17,238,355	22,561,709	6.7%
2	Scurte	-94,628,526	-90,571,639	100.0%
(i)	Euro	-57,992,551	-58,822,438	64.9%
(ii)	Dolari SUA	-14,252,257	-16,949,564	18.7%
(iii)	Ruble ruseşti	-11,055,794	-5,608,409	6.2%
(iv)	Lei româneşti	-742,736	-313,081	0.4%
(v)	Alte valute străine	-10,585,188	-8,878,147	9.8%
D.	Capital normativ total	9,696,209,081	9,668,056,653	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	1.00	0.99	
(ii)	Dolari SUA	1.41	1.76	
(iii)	Ruble ruseşti	0.12	0.36	
(iv)	Lei româneşti	0.13	0.11	
(v)	Alte valute străine	0.18	0.23	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.60	-0.61	
(ii)	Dolari SUA	-0.15	-0.18	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.11	-0.06	
(iv)	Lei româneşti	-0.01	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.11	-0.09	

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/53779

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