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

22.06.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna mai 2016

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna mai 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)	37,617,262,651	35,207,279,693	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	29,661,022,856	29,669,863,685	84.3%
A.1	Total active bilanţiere în valută straină	28,624,007,222	28,629,220,901	81.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	9,594,702,250	9,313,397,255	26.4%
(i)	Numerar	2,445,834,165	2,423,353,612	6.9%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	5,662,319,639	5,537,817,742	15.7%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	809,475,203	810,973,536	2.3%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	649,316,774	515,606,227	1.4%
(v)	Valori mobiliare	27,756,469	25,646,139	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	16,082,392,027	16,164,265,281	45.9%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,484,473,640	3,544,580,549	10.1%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,467,279,751	-1,446,801,999	-4.1%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	929,719,056	1,053,779,815	3.0%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	7,956,239,795	5,537,416,008	15.7%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	133,454,876	112,889,731	0.3%

2	Alte active condiţionale în valută străină	7,822,784,919	5,424,526,276	15.4%
A.3	**Total active ataşate la cursul valutei străine**	1,037,015,634	1,040,642,785	3.0%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,111,355,932	1,115,708,308	3.2%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-85,410,163	-86,034,944	-0.2%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,069,865	10,969,422	0.0%
B.	**Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)**	37,359,837,163	35,052,089,762	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	29,409,620,746	29,514,876,926	84.2%
B.1	**Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină**	29,409,493,062	29,514,778,879	84.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,866,682	1,740,116	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	22,469,500	22,644,766	0.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,725,479,409	7,656,200,665	21.8%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	14,615,088,177	14,665,434,766	41.8%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,328,907,787	3,378,355,917	9.6%
6	Credite primite în valută străină	3,229,907,316	3,276,219,565	9.4%
7	Ajustări	-10,374,264	-10,590,675	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	496,148,455	524,773,758	1.5%
B.2	**Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)**	7,950,216,417	5,537,212,836	15.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	133,472,285	116,604,894	0.3%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	7,816,744,132	5,420,607,943	15.5%
B.3	**Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine**	127,684	98,047	0.0%
	inclusiv pe categorii			

	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	127,684	98,047	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	348,298,686	254,849,036	100.0%
(i)	Euro	169,074,788	100,506,378	39.5%
(ii)	Dolari SUA	126,646,235	99,890,345	39.2%
(iii)	Ruble ruseşti	13,997,415	15,551,441	6.1%
(iv)	Lei româneşti	16,377,505	15,111,763	5.9%
(v)	Alte valute străine	22,202,743	23,789,109	9.3%
2	Scurte	-90,873,186	-99,673,970	100.0%
(i)	Euro	-21,893,886	-48,206,650	48.4%
(ii)	Dolari SUA	-59,622,291	-39,359,724	39.5%
(iii)	Ruble ruseşti	-4,823,269	-5,277,140	5.3%
(iv)	Lei româneşti	-67,889	-224,087	0.2%
(v)	Alte valute străine	-4,465,851	-6,606,369	6.6%
D.	Capital normativ total	9,773,567,079	9,752,633,348	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	1.73	1.03	
(ii)	Dolari SUA	1.30	1.03	
(iii)	Ruble ruseşti	0.14	0.16	
(iv)	Lei româneşti	0.17	0.15	
(v)	Alte valute străine	0.23	0.24	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.22	-0.49	
(ii)	Dolari SUA	-0.61	-0.40	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.05	-0.05	
(iv)	Lei româneşti	0.00	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.05	-0.07	

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/53859

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