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

22.07.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna iunie 2016

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna iunie 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)	30,863,299,152	31,359,018,401	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	29,293,884,729	29,436,543,682	93.9%
A.1	Total active bilanţiere în valută straină	28,239,844,023	28,379,385,036	90.5%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	9,711,008,039	9,671,500,515	30.8%
(i)	Numerar	2,632,741,140	2,427,537,659	7.7%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	5,424,645,457	5,735,349,894	18.3%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,114,730,574	1,031,849,580	3.3%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	512,738,202	449,128,458	1.4%
(v)	Valori mobiliare	26,152,666	27,634,924	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	15,964,898,910	15,941,919,228	50.8%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,456,608,375	3,474,515,536	11.1%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,512,484,148	-1,483,727,687	-4.7%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	619,812,847	775,177,444	2.5%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	1,569,414,423	1,922,474,719	6.1%

	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	142,257,864	99,527,035	0.3%
2	Alte active condiţionale în valută străină	1,427,156,559	1,822,947,685	5.8%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,054,040,706	1,057,158,646	3.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,127,931,862	1,126,920,914	3.6%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-84,932,542	-82,838,450	-0.2%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,041,386	13,076,182	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	30,431,168,369	31,063,780,089	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	28,866,002,737	29,147,226,557	93.8%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	28,865,912,231	29,147,125,978	93.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,684,362	1,746,699	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	22,218,380	22,427,968	0.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,678,588,599	7,697,228,458	24.8%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	14,366,337,726	14,486,962,707	46.6%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,340,643,714	3,355,374,029	10.8%
6	Credite primite în valută străină	2,970,983,300	3,088,788,658	9.9%
7	Ajustări	-9,991,968	-10,228,553	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	495,448,118	504,826,013	1.6%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	1,565,165,632	1,916,553,531	6.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	143,400,183	99,027,830	0.3%

2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	1,421,765,449	1,817,525,702	5.9%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	90,506	100,579	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	90,506	100,579	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	455,663,943	356,150,266	100.0%
(i)	Euro	177,856,167	111,479,794	31.3%
(ii)	Dolari SUA	219,328,898	196,143,315	55.1%
(iii)	Ruble ruseşti	22,056,357	9,538,845	2.7%
(iv)	Lei româneşti	13,495,555	14,932,577	4.2%
(v)	Alte valute străine	22,926,966	24,055,735	6.7%
2	Scurte	-23,533,149	-60,932,538	100.0%
(i)	Euro	-14,266,600	-29,722,524	48.8%
(ii)	Dolari SUA	-406,513	-18,618,970	30.5%
(iii)	Ruble ruseşti	-6,760,928	-8,950,589	14.7%
(iv)	Lei româneşti	0	-33,224	0.1%
(v)	Alte valute străine	-2,099,108	-3,607,231	5.9%
D.	Capital normativ total	9,333,986,804	9,453,970,388	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	1.91	1.18	
(ii)	Dolari SUA	2.35	2.07	
(iii)	Ruble ruseşti	0.24	0.10	
(iv)	Lei româneşti	0.14	0.16	
(v)	Alte valute străine	0.25	0.25	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.15	-0.31	
(ii)	Dolari SUA	0.00	-0.20	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.07	-0.09	
(iv)	Lei românești	0.00	0.00	

(iv)		Lei românești	0.00	0.00	
(v)		Alte valute străine	-0.02	-0.04	

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/53941

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