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

22.08.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna iulie 2016

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna iulie 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)	30,746,520,813	30,529,328,589	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	28,623,413,226	29,033,670,385	95.1%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	27,576,763,057	27,983,754,174	91.7%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	8,929,164,695	9,395,479,658	30.8%
(i)	Numerar	2,469,712,075	2,481,123,228	8.1%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	4,860,048,763	5,456,259,154	17.9%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	953,701,601	966,115,885	3.2%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	619,444,945	465,256,385	1.5%
(v)	Valori mobiliare	26,257,311	26,725,006	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	16,064,671,694	15,971,315,681	52.3%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,435,623,220	3,443,985,189	11.3%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,594,430,204	-1,543,600,825	-5.1%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	741,733,652	716,574,472	2.4%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	2,123,107,587	1,495,658,204	4.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	61,026,940	75,708,102	0.2%

2	Alte active condiţionale în valută străină	2,062,080,647	1,419,950,102	4.7%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,046,650,169	1,049,916,210	3.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,116,551,960	1,122,997,560	3.7%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-80,105,006	-83,451,845	-0.3%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	10,203,215	10,370,495	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	30,494,647,703	30,286,214,026	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	28,375,968,658	28,794,154,677	95.1%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	28,375,928,724	28,794,090,596	95.1%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,767,445	1,911,737	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	22,096,620	22,125,950	0.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,497,417,673	7,731,403,788	25.5%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	14,128,478,441	14,246,912,538	47.0%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,370,910,998	3,360,758,256	11.1%
6	Credite primite în valută străină	2,870,300,478	2,925,844,671	9.7%
7	Ajustări	-9,088,684	-9,526,392	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	494,045,753	514,660,050	1.7%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	2,118,679,045	1,492,059,349	4.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	61,506,594	76,596,084	0.2%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	2,057,172,451	1,415,463,265	4.7%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	39,934	64,080	0.0%
	inclusiv pe categorii			

	Credite primite atașate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni atașate	39,934	64,080	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	328,748,727	346,629,405	100.0%
(i)	Euro	157,856,145	143,832,722	41.5%
(ii)	Dolari SUA	118,835,351	144,661,695	41.7%
(iii)	Ruble ruseşti	10,363,316	15,433,091	4.5%
(iv)	Lei românești	11,151,692	12,464,238	3.6%
(v)	Alte valute străine	30,542,223	30,237,659	8.7%
2	Scurte	-77,096,347	-103,520,152	100.0%
(i)	Euro	-39,953,523	-24,104,783	23.3%
(ii)	Dolari SUA	-28,651,571	-71,191,703	68.8%
(iii)	Ruble ruseşti	-5,404,436	-5,452,420	5.3%
(iv)	Lei românești	-152,261	-116,228	0.1%
(v)	Alte valute străine	-2,934,556	-2,655,018	2.5%
D.	Capital normativ total	9,026,541,330	9,141,995,674	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	1.75	1.57	
(ii)	Dolari SUA	1.32	1.57	
(iii)	Ruble ruseşti	0.11	0.17	
(iv)	Lei românești	0.12	0.14	
(v)	Alte valute străine	0.34	0.33	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.44	-0.26	
(ii)	Dolari SUA	-0.32	-0.79	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.06	-0.06	
(iv)	Lei românești	0.00	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.03	-0.03	

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/54003

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