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

20.10.2023

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna setembrie 2023

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.

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 [1] (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.

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna septembrie 2023 (lei moldoveneşti)

(lei moldoveneşti)			Datele, inclusiv activele şi obligaţiunile ataşate la cursul valutei		
			Sold		Ponderea mediei lunare
			la sfârşitul lunii	mediu lunar	
A.	**Total active valutare (A.1+A.2+A.3)**		**46,172,005,380**	**46,136,297,611**	**100.0%**
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)		**45,924,603,250**	***45,842,255,771***	**99.4%**
A.1	**Total active bilanţiere în valută**		**43,450,628,925**	**43,487,686,923**	**94.3%**
	inclusiv pe categorii				
1	Disponibilităţi în valută		**10,574,044,717**	**10,336,035,238**	**22.4%**
(i)		*Numerar*	2,775,257,885	2,796,082,320	*6.1%*
(ii)		*Conturi "Nostro" deschise în străinătate*	3,664,789,035	2,422,513,326	*5.2%*
(iii)		*Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate*	1,778,262,766	1,164,451,488	*2.5%*
(iv)		*Mijloace plasate şi credite overnight*	2,148,811,614	3,744,514,098	*8.1%*
(v)		*Valori mobiliare*	206,923,417	208,474,007	*0.5%*

2	Credite acordate în valută	16,250,566,194	16,539,120,784	35.8%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	16,705,824,444	16,632,180,861	36.1%
4	Ajustări și reduceri pentru pierderi din depreciere	-894,483,836	-925,255,762	-2.0%
5	Alte active în valută (A1-1-2-3-4)	814,677,406	905,605,801	2.0%
A.2	Total active condiţionale în valută (extrabilanţiere)	247,402,130	294,041,840	0.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută	82,859,398	105,368,997	*0.2%*
2	Alte active condiţionale în valută	164,542,732	188,672,842	*0.4%*
A.3	Total active ataşate la cursul valutei	2,473,974,325	2,354,568,848	5.1%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	2,551,367,173	2,447,754,547	*5.3%*
2	Ajustări și reduceri pentru pierderi din depreciere	-84,455,732	-99,350,977	*-0.2%*
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	7,062,884	6,165,278	*0.0%*
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	45,944,229,292	46,087,006,205	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	*45,696,460,154*	*45,787,699,064*	99.4%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută	45,696,422,615	45,787,654,996	99.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută ale băncilor din străinătate	12,241,162	10,444,209	0.0%
2	Depozite la termen în valută ale băncilor din străinătate	187,424,000	187,581,038	0.4%
3	Conturi curente în valută ale clienţilor	20,682,727,128	20,887,971,870	45.3%
4	Depozite la termen în valută ale clienţilor	13,562,641,612	13,459,575,712	29.2%
5	Depozite diverse în valută ale clienţilor	4,975,961,074	4,957,327,546	10.8%

6	Credite primite în valută	4,647,633,547	4,706,359,057	10.2%
7	Ajustări	-15,972,122	-17,493,513	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută (B1-1-2-3-4-5-6-7)	1,643,766,214	1,595,889,077	3.5%
B.2	**Total obligaţiuni condiţionale în valută (extrabilanţiere)**	**247,769,138**	**299,307,141**	**0.6%**
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută	82,979,784	104,466,878	*0.2%*
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută	164,789,354	194,840,264	*0.4%*
B.3	**Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei**	**37,539**	**44,068**	**0.0%**
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	*0.0%*
	Alte obligaţiuni ataşate	37,539	44,068	*0.0%*
C.	**Mărimea poziţiei valutare deschise**			
1	**Lungi**	**296,334,227**	**198,133,073**	**100.0%**
(i)	*Euro*	51,551,952	72,519,261	*36.6%*
(ii)	*Dolari SUA*	225,752,840	106,061,039	*53.5%*
(iii)	*Ruble ruseşti*	1,655,802	2,643,377	*1.3%*
(iv)	*Lei româneşti*	2,677,492	4,286,113	*2.2%*
(v)	*Alte valute*	14,696,141	12,623,285	*6.4%*
2	**Scurte**	**-68,558,125**	**-148,841,658**	**100.0%**
(i)	*Euro*	-57,066,463	-56,417,750	*37.9%*
(ii)	*Dolari SUA*	-2,819,705	-81,074,739	*54.5%*
(iii)	*Ruble ruseşti*	-2,088,610	-1,498,891	*1.0%*

(iv)		*Lei românești*	-1,826,110	-3,760,845	*2.5%*
(v)		*Alte valute*	-4,757,237	-6,089,433	*4.1%*
D.	**Capital normativ total**		**20,636,151,417**	**20,646,116,879**	
E.	**Raportul poziției valutare deschise (%)**				
1	**Lungi**				
(i)		*Euro*	0.25	0.35	
(ii)		*Dolari SUA*	1.09	0.51	
(iii)		*Ruble rusești*	0.01	0.01	
(iv)		*Lei românești*	0.01	0.02	
(v)		*Alte valute*	0.07	0.06	
2	**Scurte**				
(i)		*Euro*	-0.28	-0.27	
(ii)		*Dolari SUA*	-0.01	-0.39	
(iii)		*Ruble rusești*	-0.01	-0.01	
(iv)		*Lei românești*	-0.01	-0.02	
(v)		*Alte valute*	-0.02	-0.03	

See also

Tags

raportul pozitiei valutare [2]
credite in valuta [3]
depozite in valuta [4]
active bilantiere [5]
obligatiuni bilantiere [6]
Active valutare [7]
obligaţiuni valutare [8]
poziţia valutară deschisă a băncilor [9]
obligaţiuni condiţionale [10]

Source URL:
https://www.bnm.md/en/node/65948

Related links:

[1] https://www.bnm.md/ro/content/regulamentul-cu-privire-la-pozitia-valutara-deschisa-bancii-aprobat-prin-hca-al-bnm-nr-126 [2] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=raportul pozitiei valutare [3] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=credite in valuta [4] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=depozite in valuta [5] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=active bilantiere [6] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligatiuni bilantiere [7] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=Active valutare [8] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligaţiuni valutare [9] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=poziţia valutară deschisă a băncilor [10] https://www.bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligaţiuni condiţionale