Publicat pe (http://www.bnm.md)

20.10.2023

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna setembrie 2023

Informația privind activele şi obligațiunile valutare ale băncilor licențiate este întocmită în baza rapoartelor privind poziția valutară deschisă a băncii, prezentate de către băncile licențiate.

Informația privind activele şi obligațiunile valutare ale băncilor licențiate este întocmită în baza rapoartelor privind poziția valutară deschisă a băncii, prezentate de către băncile licențiate în conformitate cu Regulamentul privind poziția valutară deschisă a băncii [1] (aprobat prin Hotărîrea Consiliului de administrație al Băncii Naționale a Moldovei nr. 126 din 28 noiembrie 1997).

Informația publicată conține date agregate privind activele şi obligațiunile valutare ale băncilor licențiate, mărimea poziției valutare deschise, capitalul normativ total, raportul poziției valutare deschise.

Informația privind activele şi obligațiunile valutare ale băncilor licențiate este prezentată după cum urmează:

1) active valutare, care includ:

a)activele valutare bilanțiere:

- activele bilanțiere în valută străină – numerarul, mijloacele în conturile "Nostro" deschise în străinătate, plasările în străinătate ale băncilor licențiate, mijloacele plasate şi creditele overnight, valorile mobiliare, creditele acordate, rezervele obligatorii plasate în BNM, alte active bilanțiere în valută străină;
- activele în lei moldoveneşti ataşate la cursul valutei străine – creditele acordate ataşate şi alte active ataşate;

b)activele condiționale în valută străină (extrabilanțiere)– cumpărările la operațiunile la termen în valută străină şi alte active condiționale în valută străină.

2) obligațiuni valutare, care includ:

a) obligațiunile valutare bilanțiere:

- obligațiunile bilanțiere în valută străină – mijloacele în conturile „Loro” ale băncilor din străinătate, depozitele la termen ale băncilor din străinătate, conturi curente ale clienților, depozitele la termen ale clienților, depozitele diverse ale clienților, creditele primite, alte obligațiuni bilanțiere în valută străină;
- obligațiunile în lei moldoveneşti ataşate la cursul valutei străine – creditele primite ataşate şi alte obligațiuni ataşate.

b)obligațiunile condiționale în valută străină (extrabilanțiere)– vînzările la operațiunile la termen în valută străină şi alte obligațiuni condiționale în valută străină.Informația privind activele şi obligațiunile valutare include datele privind soldurile (recalculate în dolari SUA) activelor şi obligațiunilor valutare la sfîrşitul lunii.

Determinarea echivalentului în dolari SUA a soldurilor menționate se efectuează cu aplicarea cursurilor oficiale ale leului moldovenesc față de dolarul SUA şi valuta străină respectivă valabile la sfîrşitul lunii.Mărimea poziției valutare deschise reprezintă diferența dintre suma activelor valutare într-o anumită valută străină şi suma obligațiunilor valutare în valuta respectivă.

Informația privind mărimea poziției valutare deschise este prezentată în valoare absolută (echivalentul în dolari SUA) la sfîrşitul lunii, separat pentru valutele străine cel mai des tranzacționate (dolarul SUA, euro, rubla rusească, leul românesc) şi pentru alte valute străine.

Raportul poziției valutare deschise reprezintă raportul dintre mărimea poziției valutare deschise şi mărimea capitalului normativ total al băncilor. Raportul poziției valutare deschise este prezentat în procente la sfîrşitul lunii pentru valutele străine sus-menționate.

Informația privind activele şi obligațiunile valutare ale băncilor licențiate se publică lunar pînă în ultima zi a lunii următoare celei de raportare.

Poziția 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 româneşti	-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 poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	0.25	0.35	
(ii)	Dolari SUA	1.09	0.51	
(iii)	Ruble ruseşti	0.01	0.01	
(iv)	Lei româneşti	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 ruseşti	-0.01	-0.01	
(iv)		Lei româneşti	-0.01	-0.02	
(v)		Alte valute	-0.02	-0.03	

Vezi și

Tag-uri
raportul pozitiei valutare [2]
credite in valuta [3]
depozite in valuta [4]
active bilantiere [5]
obligatiuni bilantiere [6]
Active valutare [7]
obligațiuni valutare [8]
poziția valutară deschisă a băncilor [9]
obligațiuni condiționale [10]

Sursa URL:
http://www.bnm.md/ro/content/activele-si-obligatiunile-valutare-ale-bancilor-licentiate-luna-setembrie-2023

Legături conexe:

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