

22.06.2016

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna mai 2016

Poziția valutară agregată pe sistemul bancar în luna mai 2016 (lei moldovenești)

(lei moldovenești)		Datele, inclusiv cu activele și obligațiunile atașate la cursul valutei străine		
		Sold		Pondere medie lunară
		la sfârșitul 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 bilanțiere (A.1+A.3)	29,661,022,856	29,669,863,685	84.3%
A.1	Total active bilanțiere în valută străină	28,624,007,222	28,629,220,901	81.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilități 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 licențiate	809,475,203	810,973,536	2.3%
(iv)	Mijloace plasate și 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	Ajustări și 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 condiționale în valută străină (extrabilanțiere)	7,956,239,795	5,537,416,008	15.7%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărări la operațiuni la termen în valută străină	133,454,876	112,889,731	0.3%
2	Alte active condiționale în valută străină	7,822,784,919	5,424,526,276	15.4%
A.3	Total active atașate la cursul valutei străine	1,037,015,634	1,040,642,785	3.0%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate atașate	1,111,355,932	1,115,708,308	3.2%
2	Ajustări și reduceri pentru pierderi din depreciere	-85,410,163	-86,034,944	-0.2%

3	Alte active atașate (A3-1-2)	11,069,865	10,969,422	0.0%
B.	Total obligațiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	37,359,837,163	35,052,089,762	100.0%
	Total obligațiuni valutare bilanțiere (B.1+B.3)	29,409,620,746	29,514,876,926	84.2%
B.1	Total obligațiuni bilanțiere 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 clienților	7,725,479,409	7,656,200,665	21.8%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienților	14,615,088,177	14,665,434,766	41.8%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienților	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 obligațiuni bilanțiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	496,148,455	524,773,758	1.5%
B.2	Total obligațiuni condiționale în valută străină (extrabilanțiere)	7,950,216,417	5,537,212,836	15.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operațiuni la termen în valută străină	133,472,285	116,604,894	0.3%
2	Alte obligațiuni condiționale în valută străină	7,816,744,132	5,420,607,943	15.5%
B.3	Total obligațiuni atașate la cursul valutei străine	127,684	98,047	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite atașate	0	0	0.0%
	Alte obligațiuni atașate	127,684	98,047	0.0%
C.	Mărimea poziției 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 rusești	13,997,415	15,551,441	6.1%
(iv)	Lei românești	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 rusești	-4,823,269	-5,277,140	5.3%

(iv)		Lei românești	-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 poziției valutare deschise (%)				
1	Lunghi				
(i)		Euro	1.73	1.03	
(ii)		Dolari SUA	1.30	1.03	
(iii)		Ruble rusești	0.14	0.16	
(iv)		Lei românești	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 rusești	-0.05	-0.05	
(iv)		Lei românești	0.00	0.00	
(v)		Alte valute străine	-0.05	-0.07	

Statistica [1]

Informația privind activele și 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](#) [2] (aprobat prin Hotărîrea Consiliului de administrație al Băncii Naționale a Moldovei nr. 126 din 28 noiembrie 1997).

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

Informația privind activele și 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 și creditele overnight, valorile mobiliare, creditele acordate, rezervele obligatorii plasate în BNM, alte active bilanțiere în valută străină;
- activele în lei moldovenești atașate la cursul valutei străine – creditele acordate atașate și alte active atașate;

b) activele condiționale în valută străină (extrabilanțiere) – cumpărările la operațiunile la termen în valută străină și 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 moldovenești atașate la cursul valutei străine – creditele primite atașate și alte obligațiuni atașate.

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

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

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

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

Informația privind activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate 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]

[obligațiuni valutare](#) ^[9]

[poziția valutară deschisă a băncilor](#) ^[10]

[obligațiuni condiționale](#) ^[11]

Source URL:

<http://bnm.md/en/node/53859>

Related links:

[1] <http://bnm.md/bdi/pages/reports/dovre/DOVRE4.xhtml?id=0&lang=ro> [2] <http://bnm.md/ro/content/regulamentul-cu-privire-la-pozitia-valutara-deschisa-bancii-aprobat-prin-hca-al-bnm-nr-126> [3] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=raportul_pozitiei_valutare](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=raportul_pozitiei_valutare) [4] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=credite_in_valuta](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=credite_in_valuta) [5] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=depozite_in_valuta](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=depozite_in_valuta) [6] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=active_bilantiere](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=active_bilantiere) [7] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=obligatiuni_bilantiere](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligatiuni_bilantiere) [8] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=Active_valutare](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=Active_valutare) [9] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=obligațiuni_valutare](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligațiuni_valutare) [10] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=poziția_valutară_deschisă_a_băncilor](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=poziția_valutară_deschisă_a_băncilor) [11] [http://bnm.md/en/search?hashtags\[0\]=obligațiuni_condiționale](http://bnm.md/en/search?hashtags[0]=obligațiuni_condiționale)