Publicat pe (https://bnm.md)

25.03.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna februarie 2015

(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)	57,071,914,821	57,295,251,778	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	56,424,284,280	56,553,392,513	98.7%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	55,186,961,907	55,315,036,126	96.5%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	13,378,970,810	13,189,470,114	23.0%
(i)	Numerar	1,557,663,373	1,500,763,506	2.6%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	10,476,750,166	10,234,046,918	17.9%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	984,575,865	939,093,252	1.6%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	335,259,815	493,513,853	0.9%
(v)	Valori mobiliare	24,721,591	22,052,586	0.0%
2	Credite acordate în valută străină	17,551,086,677	17,848,601,457	31.2%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	4,216,429,834	4,202,784,604	7.3%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	1,963,535,785	1,982,266,265	3.5%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3+4)	22,004,010,371	22,056,446,215	38.5%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	647,630,541	741,859,265	1.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	351,151,627	318,980,146	0.6%
2	Alte active condiţionale în valută străină	296,478,914	422,879,119	0.7%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,237,322,373	1,238,356,388	2.2%

	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,294,139,134	1,294,701,358	2.3%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	66,165,874	66,244,291	0.1%
3	Alte active ataşate	9,349,113	9,899,320	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	50,609,109,199	51,052,757,175	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	49,528,233,065	49,905,290,046	97.8%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	49,528,225,005	49,905,282,467	97.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	17,722,141	17,460,321	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	513,216,960	512,090,656	1.0%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	8,149,956,057	8,361,948,446	16.4%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	18,762,079,807	18,913,934,532	37.1%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,703,617,013	3,673,466,896	7.2%
6	Credite primite în valută străină	5,188,673,733	5,256,720,996	10.3%
7	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină	13,206,698,476	13,183,682,972	25.8%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	1,080,876,134	1,147,467,129	2.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	710,408,571	700,986,844	1.4%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	370,467,563	446,480,285	0.8%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	8,060	7,579	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	8,060	7,579	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi*	6,516,573,697	6,364,554,512	100.0%
(i)	Euro	3,550,647,515	3,418,696,066	53.7%
(ii)	Dolari SUA	2,837,236,346	2,809,398,174	44.1%
(iii)	Ruble ruseşti	97,556,922	100,800,417	1.6%
(iv)	Lei româneşti	5,258,956	5,269,658	0.1%
(v)	Alte valute străine	25,873,958	30,390,197	0.5%
2	Scurte**	-53,768,068	-122,096,049	100.0%

2	Scurte***	-53,768,068	-122,096,049	100.0%
(i)	Euro	-4,665,592	-54,774,763	44.9%
(ii)	Dolari SUA	-31,645,809	-32,815,992	26.9%
(iii)	Ruble ruseşti	-13,043,028	-31,812,614	26.1%
(iv)	Lei româneşti	-276,758	-553,244	0.4%
(v)	Alte valute străine	-4,136,881	-2,139,435	1.7%
D.	Capital normativ total	9,094,060,067	9,079,233,806	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi***			
(i)	Euro	39.04	37.65	
(ii)	Dolari SUA	31.20	30.94	
(iii)	Ruble ruseşti	1.07	1.11	
(iv)	Lei româneşti	0.06	0.06	
(v)	Alte valute străine	0.28	0.33	
2	Scurte****			
(i)	Euro	-0.05	-0.60	
(ii)	Dolari SUA	-0.35	-0.36	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.14	-0.35	
(iv)	Lei româneşti	0.00	-0.01	
(v)	Alte valute străine	-0.05	-0.02	

*Mărimea poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei 214.09 mil.MDL, dintre care în Euro: 112.24 mil.MDL; Dolari SUA: 72.68 mil.MDL; Ruble rusești: 18.22 mil.MDL

**Mărimea poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei -41.67 mil.MDL, dintre care în Euro: -4.67 mil.MDL; Dolari SUA: -31.65 mil.MDL; Ruble rusești: -0.94 mil.MDL

***Raportul poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: 1.42 %; Dolari SUA: 0.92 %; Ruble rusești:0.23 %

****Raportul poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: -0.06 %; Dolari SUA: -0.4 %; Ruble rusești:-0.01 %

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.

Vezi și

Tag-uri
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]

Sursa URL:
https://bnm.md/ro/content/activele-si-obligatiunile-valutare-ale-bancilor-licentiate-luna-februarie-2015

Legături conexe:

[1] https://bnm.md/bdi/pages/reports/dovre/DOVRE4.xhtml?id=0&lang=ro [2] https://bnm.md/ro/content/regulamentul-cu-privire-la-pozitia-valutara-deschisa-bancii-aprobat-prin-hca-al-bnm-nr-126 [3] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=raportul pozitiei valutare [4] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=credite in valuta [5] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=depozite in valuta [6] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=active bilantiere [7] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=obligatiuni bilantiere [8] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=Active valutare [9] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=obligaţiuni valutare [10] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=poziţia valutară deschisă a băncilor [11] https://bnm.md/ro/search?hashtags[0]=obligaţiuni condiţionale