Publicat pe (https://bnm.md)

25.08.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna iulie 2015

(lei moldovenești)			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)		52,391,895,391	53,331,849,039	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)		51,730,396,043	52,746,265,860	98.9%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină		50,454,855,943	51,448,732,738	96.5%
	inclusiv pe categorii				
1	Disponibilităţi în valută străină		11,577,167,785	11,891,876,848	22.3%
(i)		Numerar	1,554,205,835	1,587,236,521	3.0%
(ii)		Conturi "Nostro" deschise în străinătate	7,965,880,014	8,479,480,977	15.9%
(iii)		Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,216,711,385	1,216,545,991	2.3%
(iv)		Mijloace plasate şi credite overnight	825,134,557	593,300,598	1.1%
(v)		Valori mobiliare	15,235,994	15,312,762	0.0%
2	Credite acordate în valută străină		17,779,279,710	18,074,988,100	33.9%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM		4,048,779,152	4,115,896,472	7.7%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere		-4,563,225,540	-4,571,751,953	-8.5%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)		21,612,854,836	21,937,723,271	41.1%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)		661,499,348	585,583,178	1.1%
	inclusiv pe categorii				
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină		286,250,083	293,881,171	0.6%
2	Alte active condiţionale în valută străină		375,249,265	291,702,008	0.5%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine		1,275,540,100	1,297,533,122	2.4%
	inclusiv pe categorii				

	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,336,520,878	1,359,421,603	2.5%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-71,050,070	-72,050,583	-0.1%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	10,069,292	10,162,102	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	43,688,366,868	44,423,865,082	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	42,599,300,395	43,413,396,468	97.7%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	42,599,292,369	43,413,394,297	97.7%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	16,732,884	17,199,507	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	484,262,580	490,907,857	1.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,194,417,256	7,373,251,312	16.6%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	16,760,820,444	17,132,763,530	38.5%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,431,550,019	3,412,675,118	7.7%
6	Credite primite în valută străină	3,987,277,027	4,124,976,399	9.3%
7	Ajustări	-10,036,200	-10,374,248	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	10,734,268,359	10,871,994,822	24.5%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	1,089,066,473	1,010,468,614	2.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	628,359,386	639,463,232	1.5%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	460,707,087	371,005,382	0.8%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	8,026	2,171	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	8,026	2,171	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi*	8,963,201,923	9,073,210,793	100.0%
(i)	Euro	4,757,258,744	4,736,833,916	52.2%
(ii)	Dolari SUA	4,061,879,156	4,179,168,843	46.1%
(iii)	Ruble ruseşti	113,076,692	117,763,478	1.3%
(iv)	Lei româneşti	10,833,386	10,912,647	0.1%
(v)	Alte valute străine	20,153,945	28,531,909	0.3%

2	Scurte**	-259,673,387	-165,822,501	100.0%
(i)	Euro	-178,308,858	-89,152,116	53.8%
(ii)	Dolari SUA	-42,506,755	-45,431,287	27.4%
(iii)	Ruble ruseşti	-37,232,650	-29,478,412	17.8%
(iv)	Lei româneşti	-66,671	-183,577	0.1%
(v)	Alte valute străine	-1,558,453	-1,577,108	0.9%
D.	Capital normativ total	9,699,110,338	9,694,074,881	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi***			
(i)	Euro	49.05	48.86	
(ii)	Dolari SUA	41.88	43.11	
(iii)	Ruble ruseşti	1.17	1.21	
(iv)	Lei româneşti	0.11	0.11	
(v)	Alte valute străine	0.21	0.29	
2	Scurte****			
(i)	Euro	-1.84	-0.92	
(ii)	Dolari SUA	-0.44	-0.47	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.38	-0.30	
(iv)	Lei româneşti	0.00	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.02	-0.02	

*Mărimea poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei 130.31 mil.MDL, dintre care în Euro: 1.8 mil.MDL; Dolari SUA: 78.84 mil.MDL; Ruble rusești: 34.01 mil.MDL

**Mărimea poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei -224.42 mil.MDL, dintre care în Euro: -178.31 mil.MDL; Dolari SUA: -42.51 mil.MDL; Ruble rusești: -1.98 mil.MDL

***Raportul poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: 0.02 %; Dolari SUA: 0.92 %; Ruble rusești:0.4 %

****Raportul poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: -2.09 %; Dolari SUA: -0.5 %; Ruble rusești:-0.02 %

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-iulie-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