Publicat pe (https://bnm.md)

22.12.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna noiembrie 2015

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna noiembrie 2015 (lei moldoveneşti).

(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)		31,455,848,328	31,491,714,635	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)		30,865,990,135	31,302,125,132	99.4%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină		29,810,129,368	30,234,114,874	96.0%
	inclusiv pe categorii				
1	Disponibilităţi în valută străină		10,264,023,774	10,588,976,295	33.6%
(i)		Numerar	1,415,417,189	1,443,470,289	4.6%
(ii)		Conturi "Nostro" deschise în străinătate	6,821,413,857	7,320,294,700	23.2%
(iii)		Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,133,224,772	1,226,240,151	3.9%
(iv)		Mijloace plasate şi credite overnight	868,352,120	573,884,021	1.8%
(v)		Valori mobiliare	25,615,836	25,087,134	0.1%
2	Credite acordate în valută străină		16,116,752,515	16,225,055,408	51.5%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM		3,597,700,930	3,597,385,874	11.4%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere		-910,306,737	-884,215,122	-2.8%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)		741,958,886	706,912,420	2.3%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)		589,858,193	189,589,504	0.6%
	inclusiv pe categorii				
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină		43,504,675	76,998,602	0.2%

2	Alte active condiţionale în valută străină	546,353,518	112,590,901	0.4%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,055,860,767	1,068,010,257	3.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,117,303,951	1,128,613,217	3.6%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-73,402,865	-72,329,270	-0.2%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,959,681	11,726,311	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	31,178,521,931	31,243,230,060	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	30,594,174,643	31,059,958,774	99.4%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	30,594,170,084	31,059,952,932	99.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,622,410	1,658,146	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	82,885,000	140,207,420	0.4%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,572,626,854	7,765,566,710	24.9%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	15,340,098,326	15,451,633,093	49.5%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,420,670,571	3,449,083,925	11.0%
6	Credite primite în valută străină	3,579,560,714	3,672,694,686	11.7%
7	Ajustări	-10,581,373	-10,790,871	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	607,287,582	589,899,822	1.9%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	584,347,288	183,271,286	0.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	43,743,830	76,915,061	0.3%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	540,603,458	106,356,226	0.3%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	4,559	5,842	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%

	Alte obligaţiuni ataşate	4,559	5,842	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	345,342,663	327,764,077	100.0%
(i)	Euro	46,597,413	114,519,722	34.9%
(ii)	Dolari SUA	265,100,745	170,594,827	52.1%
(iii)	Ruble ruseşti	6,816,979	20,094,769	6.1%
(iv)	Lei româneşti	8,657,720	5,977,943	1.8%
(v)	Alte valute străine	18,169,806	16,576,817	5.1%
2	Scurte	-68,127,431	-79,561,054	100.0%
(i)	Euro	-35,111,022	-35,247,290	44.3%
(ii)	Dolari SUA	-18,492,587	-26,475,153	33.3%
(iii)	Ruble ruseşti	-5,154,319	-7,998,621	10.1%
(iv)	Lei româneşti	-300,824	-93,532	0.1%
(v)	Alte valute străine	-9,068,679	-9,746,458	12.2%
D.	Capital normativ total	9,026,188,790	8,991,211,566	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	0.52	1.27	
(ii)	Dolari SUA	2.94	1.90	
(iii)	Ruble ruseşti	0.08	0.22	
(iv)	Lei româneşti	0.10	0.07	
(v)	Alte valute străine	0.20	0.18	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.39	-0.39	
(ii)	Dolari SUA	-0.20	-0.29	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.06	-0.09	
(iv)	Lei româneşti	0.00	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.10	-0.11	

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-noiembrie-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