Publicat pe (https://bnm.md)

21.12.2022

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna noiembrie 2022

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.

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 [1] (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.

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna noiembrie 2022 (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)**	**45.987.821.858**	**45.432.004.554**	**100,0%**
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	**45.081.154.631**	**44.401.555.259**	**97,7%**
A.1	**Total active bilanţiere în valută**	**42.701.334.086**	**42.086.861.114**	**92,6%**
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută	7.715.743.417	7.531.788.008	16,6%
(i)	Numerar	2.929.911.027	2.705.764.322	6,0%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	2.028.023.751	2.546.453.082	5,6%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	905.772.234	1.043.040.959	2,3%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	1.634.253.963	1.024.155.536	2,2%
(v)	Valori mobiliare	217.782.442	212.374.109	0,5%
2	Credite acordate în valută	18.123.262.691	17.696.521.685	38,9%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	17.375.561.395	17.077.913.349	37,6%
4	Ajustări și reduceri pentru pierderi din depreciere	-1.367.111.779	-1.302.956.907	-2,9%
5	Alte active în valută (A1-1-2-3-4)	853.878.362	1.083.594.980	2,4%

A.2	**Total active condiţionale în valută (extrabilanţiere)**	**906.667.227**	**1.030.449.295**	**2,3%**
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută	363.092.625	288.587.726	0,7%
2	Alte active condiţionale în valută	543.574.602	741.861.569	1,6%
A.3	**Total active ataşate la cursul valutei**	**2.379.820.545**	**2.314.694.145**	**5,1%**
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	2.477.290.799	2.407.769.025	5,3%
2	Ajustări şi reduceri pentru pierderi din depreciere	-102.264.437	-97.855.855	-0,2%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	4.794.183	4.780.975	0,0%
B.	**Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)**	**45.681.573.720**	**45.258.084.945**	**100,0%**
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	44.852.813.757	44.094.381.606	97,4%
B.1	**Total obligaţiuni bilanţiere în valută**	**44.852.731.630**	**44.094.297.192**	**97,4%**
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută ale băncilor din străinătate	155.251.494	91.562.102	0,2%
2	Depozite la termen în valută ale băncilor din străinătate	589.956.650	665.589.330	1,5%
3	Conturi curente în valută ale clienţilor	21.486.156.638	22.023.001.243	48,7%
4	Depozite la termen în valută ale clienţilor	10.757.836.196	9.887.539.167	21,8%
5	Depozite diverse în valută ale clienţilor	5.050.970.259	4.937.305.178	10,9%
6	Credite primite în valută	4.963.191.419	4.733.291.192	10,4%
7	Ajustări	-14.159.551	-14.030.764	0,0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută (B1-1-2-3-4-5-6-7)	1.863.528.525	1.770.039.744	3,9%
B.2	**Total obligaţiuni condiţionale în valută (extrabilanţiere)**	**828.759.963**	**1.163.703.339**	**2,6%**
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută	362.449.882	398.415.243	0,9%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută	466.310.081	765.288.096	1,7%
B.3	**Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei**	**82.127**	**84.414**	**0,0%**
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0,0%
	Alte obligaţiuni ataşate	82.127	84.414	0,0%
C.	**Mărimea poziţiei valutare deschise**			
1	Lungi	415.046.057	312.251.149	100,0%
(i)	Euro	115.705.900	64.741.042	20,7%

(ii)	Dolari SUA	282.868.769	228.991.544	73,4%
(iii)	Ruble ruseşti	7.422.885	7.264.570	2,3%
(iv)	Lei românești	3.621.268	3.812.850	1,2%
(v)	Alte valute	5.427.235	7.441.143	2,4%
2	Scurte	-108.797.909	-138.328.128	100,0%
(i)	Euro	-50.550.133	-52.950.201	38,3%
(ii)	Dolari SUA	-41.548.963	-70.025.442	50,6%
(iii)	Ruble ruseşti	-6.990.559	-3.739.891	2,7%
(iv)	Lei românești	-2.751.109	-2.504.703	1,8%
(v)	Alte valute	-6.957.145	-9.107.891	6,6%
D.	Capital normativ total	18.274.092.157	18.136.531.893	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	0,63	0,36	
(ii)	Dolari SUA	1,55	1,26	
(iii)	Ruble ruseşti	0,04	0,04	
(iv)	Lei românești	0,02	0,02	
(v)	Alte valute	0,03	0,04	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0,28	-0,29	
(ii)	Dolari SUA	-0,23	-0,39	
(iii)	Ruble ruseşti	-0,04	-0,02	
(iv)	Lei românești	-0,02	-0,01	
(v)	Alte valute	-0,04	-0,05	

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]

obligaţiuni valutare [8]

poziţia valutară deschisă a băncilor [9]

obligaţiuni condiţionale [10]

Sursa URL:
https://bnm.md/ro/content/activele-si-obligatiunile-valutare-ale-bancilor-licentiate-luna-noiembrie-2022

Legături conexe:

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