Publicat pe (https://bnm.md)

26.10.2015

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate în luna septembrie 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)	54,476,407,205	54,390,183,459	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	53,642,700,454	53,727,200,869	98.8%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	52,516,322,137	52,428,712,833	96.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	12,195,769,837	11,798,326,159	21.7%
(i)	Numerar	1,857,668,150	1,900,476,551	3.5%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	7,909,828,053	7,861,476,009	14.5%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,494,499,785	1,340,933,031	2.5%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	908,270,718	673,086,010	1.2%
(v)	Valori mobiliare	25,503,131	22,354,558	0.0%
2	Credite acordate în valută străină	18,923,987,321	18,512,072,380	34.0%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	4,283,211,512	4,203,339,085	7.7%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-6,225,421,864	-4,967,024,777	-9.1%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	23,338,775,331	22,881,999,986	42.1%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	833,706,751	662,982,590	1.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	377,712,625	329,433,877	0.6%
2	Alte active condiţionale în valută străină	455,994,126	333,548,713	0.6%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,126,378,317	1,298,488,036	2.4%
	inclusiv pe categorii			

	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,191,816,819	1,362,216,439	2.5%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-77,334,505	-75,171,420	-0.1%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	11,896,003	11,443,017	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	45,287,959,452	44,732,748,561	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	44,421,785,539	43,685,284,457	97.7%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	44,421,778,733	43,685,278,856	97.7%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	18,244,906	17,552,373	0.1%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	518,945,250	506,057,413	1.1%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	8,004,989,855	7,882,093,948	17.6%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	16,665,173,563	16,379,892,733	36.6%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,563,389,750	3,535,979,654	7.9%
6	Credite primite în valută străină	4,157,928,251	4,081,775,640	9.1%
7	Ajustări	-11,503,726	-10,599,081	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	11,504,610,884	11,292,526,176	25.3%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	866,173,913	1,047,464,104	2.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	321,698,225	625,474,978	1.4%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	544,475,688	421,989,126	0.9%
B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	6,806	5,601	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	6,806	5,601	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi*	9,338,178,492	9,838,243,535	100.0%
(i)	Euro	5,386,547,909	5,513,756,973	56.0%
(ii)	Dolari SUA	3,828,334,818	4,190,983,125	42.6%
(iii)	Ruble ruseşti	92,807,777	93,914,360	1.0%
(iv)	Lei româneşti	7,779,401	7,912,793	0.1%
(v)	Alte valute străine	22,708,587	31,676,284	0.3%

2	Scurte**	-149,730,725	-181,221,091	100.0%
(i)	Euro	-45,954,467	-66,706,525	36.8%
(ii)	Dolari SUA	-50,024,388	-61,259,713	33.8%
(iii)	Ruble ruseşti	-51,379,165	-48,821,926	27.0%
(iv)	Lei româneşti	-57,887	-782,669	0.4%
(v)	Alte valute străine	-2,314,818	-3,650,258	2.0%
D.	Capital normativ total	10,024,257,734	9,971,857,147	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi***			
(i)	Euro	53.74	55.29	
(ii)	Dolari SUA	38.19	42.03	
(iii)	Ruble ruseşti	0.93	0.94	
(iv)	Lei româneşti	0.08	0.08	
(v)	Alte valute străine	0.23	0.32	
2	Scurte****			
(i)	Euro	-0.46	-0.67	
(ii)	Dolari SUA	-0.50	-0.62	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.51	-0.49	
(iv)	Lei româneşti	0.00	-0.01	
(v)	Alte valute străine	-0.02	-0.04	

*Mărimea poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei 404.25 mil.MDL, dintre care în Euro: 159.98 mil.MDL; Dolari SUA: 208.21 mil.MDL; Ruble rusești: 16.88 mil.MDL.

**Mărimea poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei -103.33 mil.MDL, dintre care în Euro: -45.95 mil.MDL; Dolari SUA: -50.02 mil.MDL; Ruble rusești: -4.98 mil.MDL.

***Raportul poziției valutare deschise lungi, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: 1.84 %; Dolari SUA: 2.4 %; Ruble rusești:0.19%.

****Raportul poziției valutare deschise scurte, excluzând Banca de Economii, Banca Socială și Unibank, a constituit la sfârștitul perioadei în Euro: -0.53 %; Dolari SUA: -0.58 %; Ruble rusești:-0.06 %

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-septembrie-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