Published on (https://www.bnm.md)

23.01.2017

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna decembrie 2016

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.

Poziţia valutară agregată pe sistemul bancar în luna decembrie 2016 (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)	30,724,958,825	31,608,696,797	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	28,366,214,757	28,738,820,977	90.9%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	27,338,749,897	27,704,631,527	87.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	9,953,488,800	9,787,718,974	31.0%
(i)	Numerar	1,947,796,895	1,944,943,254	6.2%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	6,310,829,790	6,259,014,016	19.8%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,020,466,535	1,017,400,818	3.2%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	633,843,976	524,249,407	1.7%
(v)	Valori mobiliare	40,551,604	42,111,479	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	15,164,993,158	15,593,416,428	49.3%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,430,147,368	3,473,489,396	11.0%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,843,306,263	-1,864,141,599	-5.9%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	633,426,834	714,148,328	2.2%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	2,358,744,068	2,869,875,820	9.1%

	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	54,312,700	95,549,743	0.3%
2	Alte active condiţionale în valută străină	2,304,431,368	2,774,326,077	8.8%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,027,464,860	1,034,189,449	3.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,104,548,793	1,109,583,683	3.5%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-86,714,146	-85,057,055	-0.2%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	9,630,213	9,662,821	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	30,553,549,496	31,249,691,082	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	28,188,750,684	28,379,676,068	90.8%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	28,188,648,473	28,379,602,639	90.8%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	73,526,873	7,935,277	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	198,900	195,104	0.0%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	8,057,850,156	8,008,391,965	25.6%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	13,857,248,821	14,007,019,987	44.8%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,444,124,113	3,470,573,899	11.1%
6	Credite primite în valută străină	2,302,606,575	2,323,426,797	7.5%
7	Ajustări	-4,393,867	-6,607,751	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	457,486,902	568,667,360	1.8%
B.2	Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	2,364,798,812	2,870,015,014	9.2%
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	60,015,764	96,124,101	0.3%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	2,304,783,048	2,773,890,913	8.9%

B.3	Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine	102,211	73,429	0.0%
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	102,211	73,429	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	268,056,984	415,004,694	100.0%
(i)	Euro	59,279,906	139,489,739	33.6%
(ii)	Dolari SUA	171,188,633	239,948,510	57.8%
(iii)	Ruble ruseşti	16,325,871	14,647,047	3.5%
(iv)	Lei româneşti	13,642,208	12,997,433	3.2%
(v)	Alte valute străine	7,620,366	7,921,966	1.9%
2	Scurte	-96,958,892	-56,021,369	100.0%
(i)	Euro	-59,956,988	-18,521,784	33.1%
(ii)	Dolari SUA	-17,702,964	-24,209,575	43.2%
(iii)	Ruble ruseşti	-15,426,741	-6,169,286	11.0%
(iv)	Lei româneşti	-529,128	-318,489	0.6%
(v)	Alte valute străine	-3,343,071	-6,802,235	12.1%
D.	Capital normativ total	9,672,111,982	9,644,565,422	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	0.61	1.45	
(ii)	Dolari SUA	1.77	2.49	
(iii)	Ruble ruseşti	0.17	0.15	
(iv)	Lei româneşti	0.14	0.13	
(v)	Alte valute străine	0.08	0.08	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.62	-0.19	
(ii)	Dolari SUA	-0.18	-0.25	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.16	-0.06	
(iv)	Lei româneşti	-0.01	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.03	-0.07	

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.

See also

Tags
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]

Source URL:
https://www.bnm.md/en/node/54502

Related links:

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