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

21.07.2017

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna iunie 2017

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 iunie 2017 (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)	28,939,647,693	28,580,909,301	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	28,143,880,029	27,996,939,788	98.0%
A.1	Total active bilanţiere în valută straină	27,081,660,400	26,943,142,929	94.3%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	10,903,348,750	10,804,514,804	37.8%
(i)	Numerar	2,753,965,252	2,540,031,552	8.9%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	6,177,207,956	6,289,902,276	22.0%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,501,482,077	1,551,016,871	5.4%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	452,549,252	405,257,170	1.4%
(v)	Valori mobiliare	18,144,213	18,306,935	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	13,948,802,413	13,752,668,134	48.1%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,420,972,972	3,392,727,139	11.9%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,817,734,665	-1,788,047,370	-6.2%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	626,270,930	781,280,222	2.7%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	795,767,664	583,969,514	2.0%

	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	94,909,988	67,259,087	0.2%
2	Alte active condiţionale în valută străină	700,857,676	516,710,427	1.8%
A.3	**Total active ataşate la cursul valutei străine**	**1,062,219,629**	**1,053,796,859**	**3.7%**
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,150,233,202	1,134,376,897	4.0%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-97,183,763	-89,473,521	-0.3%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	9,170,190	8,893,483	0.0%
B.	**Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)**	**28,834,352,226**	**28,385,091,324**	**100.0%**
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	**27,786,420,181**	**27,763,003,000**	**97.8%**
B.1	**Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină**	**27,786,386,791**	**27,762,998,823**	**97.8%**
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,453,123	1,168,583	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	184,560	188,798	0.0%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	7,726,979,795	7,896,428,301	27.8%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	13,696,171,680	13,587,747,819	47.8%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,531,302,380	3,511,286,443	12.4%
6	Credite primite în valută străină	2,352,898,224	2,234,303,287	7.9%
7	Ajustări	-5,273,757	-5,335,292	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	482,670,786	537,210,885	1.9%
B.2	**Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)**	**1,047,932,045**	**622,088,324**	**2.2%**
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	136,891,486	72,696,368	0.3%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută	911,040,559	549,391,957	1.9%

	străină			
B.3	**Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine**	**33,390**	**4,177**	**0.0%**
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	33,390	4,177	0.0%
C.	**Mărimea poziţiei valutare deschise**			
1	**Lungi**	**214,872,115**	**280,521,907**	**100.0%**
(i)	Euro	72,232,227	89,282,775	31.8%
(ii)	Dolari SUA	122,928,475	159,722,485	56.9%
(iii)	Ruble ruseşti	2,738,335	8,631,706	3.1%
(iv)	Lei româneşti	9,423,008	13,459,579	4.8%
(v)	Alte valute străine	7,550,070	9,425,362	3.4%
2	**Scurte**	**-109,576,635**	**-84,753,057**	**100.0%**
(i)	Euro	-66,166,551	-35,621,471	42.0%
(ii)	Dolari SUA	-30,488,191	-41,008,899	48.4%
(iii)	Ruble ruseşti	-11,148,863	-4,008,300	4.7%
(iv)	Lei româneşti	-463,736	-205,283	0.3%
(v)	Alte valute străine	-1,309,294	-3,909,104	4.6%
D.	**Capital normativ total**	**10,167,506,278**	**10,116,827,848**	
E.	**Raportul poziţiei valutare deschise (%)**			
1	**Lungi**			
(i)	Euro	0.71	0.88	
(ii)	Dolari SUA	1.21	1.58	
(iii)	Ruble ruseşti	0.03	0.09	
(iv)	Lei româneşti	0.09	0.13	
(v)	Alte valute străine	0.07	0.09	
2	**Scurte**			
(i)	Euro	-0.65	-0.35	
(ii)	Dolari SUA	-0.30	-0.40	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.11	-0.04	
(iv)	Lei româneşti	0.00	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.01	-0.04	

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/55496

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