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

20.10.2017

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna septembrie 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 septembrie 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)**		**30,520,128,515**	**31,184,957,983**	**100.0%**
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)		**29,848,089,855**	**30,211,565,965**	**96.9%**
A.1	**Total active bilanţiere în valută străină**		**28,783,032,142**	**29,141,501,473**	**93.5%**
	inclusiv pe categorii				
1	Disponibilităţi în valută străină		**12,428,597,227**	**12,632,450,394**	**40.5%**
(i)		*Numerar*	2,499,892,474	2,636,077,959	8.4%
(ii)		*Conturi "Nostro" deschise în străinătate*	7,725,880,047	7,952,622,966	25.5%
(iii)		*Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate*	1,355,589,422	1,359,224,671	4.4%
(iv)		*Mijloace plasate şi credite overnight*	827,996,464	665,191,507	2.1%
(v)		*Valori mobiliare*	19,238,820	19,333,291	0.1%
2	Credite acordate în valută străină		**13,810,668,306**	**13,902,956,495**	**44.6%**

3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,587,568,710	3,587,951,747	11.5%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,848,601,268	-1,866,174,310	-6.0%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	804,799,167	884,317,147	2.9%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	672,038,660	973,392,019	3.1%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	88,796,585	215,379,355	0.7%
2	Alte active condiţionale în valută străină	583,242,075	758,012,664	2.4%
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,065,057,713	1,070,064,492	3.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,148,756,216	1,154,795,157	3.7%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-92,480,575	-93,270,331	-0.3%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	8,782,072	8,539,666	0.0%
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	30,303,639,059	31,021,778,248	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	29,642,947,170	30,006,499,645	96.7%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	29,642,929,009	30,006,478,543	96.7%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	1,658,262	1,605,806	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	0	0	0.0%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	9,476,505,920	9,628,798,227	31.0%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	13,758,772,677	13,846,651,431	44.6%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,465,893,189	3,525,065,928	11.4%

6	Credite primite în valută străină	2,425,310,618	2,424,093,184	7.8%
7	Ajustări	-4,884,927	-5,080,874	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	519,673,270	585,344,841	1.9%
B.2	**Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)**	**660,691,889**	**1,015,278,603**	**3.3%**
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	88,850,006	219,386,081	0.7%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	571,841,883	795,892,522	2.6%
B.3	**Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine**	**18,161**	**21,102**	**0.0%**
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni ataşate	18,161	21,102	0.0%
C.	**Mărimea poziţiei valutare deschise**			
1	**Lungi**	**290,572,966**	**273,284,969**	**100.0%**
(i)	*Euro*	117,149,201	136,777,989	50.0%
(ii)	*Dolari SUA*	150,419,918	107,051,501	39.2%
(iii)	*Ruble ruseşti*	4,930,223	11,707,432	4.3%
(iv)	*Lei româneşti*	14,551,734	11,303,450	4.1%
(v)	*Alte valute străine*	3,521,890	6,444,598	2.4%
2	**Scurte**	**-74,083,496**	**-110,140,715**	**100.0%**
(i)	*Euro*	-36,609,408	-41,320,374	37.5%
(ii)	*Dolari SUA*	-25,982,022	-54,580,478	49.6%
(iii)	*Ruble ruseşti*	-9,011,876	-6,386,898	5.8%

(iv)		*Lei românești*	0	-122,373	0.1%
(v)		*Alte valute străine*	-2,480,190	-7,730,592	7.0%
D.	**Capital normativ total**		**10,310,503,623**	**10,252,498,643**	
E.	**Raportul poziției valutare deschise (%)**				
1	**Lungi**				
(i)		*Euro*	1.14	1.33	
(ii)		*Dolari SUA*	1.46	1.04	
(iii)		*Ruble rusești*	0.05	0.11	
(iv)		*Lei românești*	0.14	0.11	
(v)		*Alte valute străine*	0.03	0.06	
2	**Scurte**				
(i)		*Euro*	-0.36	-0.40	
(ii)		*Dolari SUA*	-0.25	-0.53	
(iii)		*Ruble rusești*	-0.09	-0.06	
(iv)		*Lei românești*	0.00	0.00	
(v)		*Alte valute străine*	-0.02	-0.08	

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.

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/55926

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