Publicat pe (https://www.bnm.md)

22.01.2018

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate pentru luna decembrie 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 decembrie 2017 (lei moldoveneşti)

(lei moldoveneşti)		Datele, inclusiv cu activele şi obligaţiunile ataşate la cursul valutei străine		
		Sold		Ponderea mediei lunare
		la sfârşitul lunii	mediu lunar	
A.	Total active valutare (A.1+A.2+A.3)	30,356,589,308	30,616,846,492	100.0%
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	*29,285,609,486*	*29,524,300,319*	96.4%
A.1	Total active bilanţiere în valută străină	28,193,891,689	28,446,647,131	92.9%
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	11,928,363,804	12,158,949,818	39.7%
(i)	*Numerar*	2,141,397,821	2,041,317,426	*6.7%*
(ii)	*Conturi "Nostro" deschise în străinătate*	7,929,240,445	8,241,676,149	*26.9%*
(iii)	*Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate*	1,066,794,494	1,239,124,599	*4.0%*
(iv)	*Mijloace plasate şi credite overnight*	773,506,316	616,260,332	*2.0%*
(v)	*Valori mobiliare*	17,424,728	20,571,313	*0.1%*

2	Credite acordate în valută străină	13,731,052,314	13,822,792,818	45.1%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,627,410,920	3,609,490,833	11.8%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,896,150,377	-1,870,737,055	-6.1%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	803,215,028	726,150,717	2.4%
A.2	Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)	1,070,979,822	1,092,546,173	3.6%
	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	132,178,456	165,745,949	*0.6%*
2	Alte active condiţionale în valută străină	938,801,366	926,800,224	*3.0%*
A.3	Total active ataşate la cursul valutei străine	1,091,717,797	1,077,653,188	3.5%
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,171,703,035	1,156,195,294	*3.8%*
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-94,528,257	-92,817,077	*-0.3%*
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	14,543,019	14,274,970	*0.0%*
B.	Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)	30,118,901,443	30,498,604,367	100.0%
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	*29,059,771,816*	*29,409,232,547*	96.4%
B.1	Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină	29,059,768,236	29,409,225,516	96.4%
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	4,028,911	3,545,494	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	51,024,750	14,556,286	0.0%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	8,398,930,555	8,984,518,914	29.5%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	13,682,514,893	13,582,390,644	44.5%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,455,780,367	3,378,505,919	11.1%

6	Credite primite în valută străină	2,712,004,720	2,729,471,847	8.9%
7	Ajustări	-4,918,935	-4,705,394	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	760,402,975	720,941,807	2.4%
B.2	**Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)**	**1,059,129,627**	**1,089,371,820**	**3.6%**
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	132,260,167	166,762,473	*0.6%*
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	926,869,460	922,609,347	*3.0%*
B.3	**Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine**	**3,580**	**7,031**	**0.0%**
	inclusiv pe categorii			
	Credite primite ataşate	0	0	*0.0%*
	Alte obligaţiuni ataşate	3,580	7,031	*0.0%*
C.	**Mărimea poziţiei valutare deschise**			
1	**Lungi**	**323,162,882**	**225,391,286**	**100.0%**
(i)	*Euro*	84,946,597	75,007,000	*33.3%*
(ii)	*Dolari SUA*	191,346,547	120,575,684	*53.5%*
(iii)	*Ruble ruseşti*	18,749,761	9,359,525	*4.1%*
(iv)	*Lei româneşti*	12,636,198	10,974,995	*4.9%*
(v)	*Alte valute străine*	15,483,779	9,474,081	*4.2%*
2	**Scurte**	**-85,475,001**	**-107,154,007**	**100.0%**
(i)	*Euro*	-47,215,729	-37,990,434	*35.5%*
(ii)	*Dolari SUA*	-37,330,552	-61,388,752	*57.3%*
(iii)	*Ruble ruseşti*	-752,864	-3,801,354	*3.5%*

(iv)		*Lei românești*	0	-522,629	*0.5%*
(v)		*Alte valute străine*	-175,856	-3,450,838	*3.2%*
D.	**Capital normativ total**		**10,747,048,156**	**10,748,501,282**	
E.	**Raportul poziţiei valutare deschise (%)**				
1	**Lungi**				
(i)		*Euro*	0.79	0.70	
(ii)		*Dolari SUA*	1.78	1.12	
(iii)		*Ruble ruseşti*	0.17	0.09	
(iv)		*Lei românești*	0.12	0.10	
(v)		*Alte valute străine*	0.14	0.09	
2	**Scurte**				
(i)		*Euro*	-0.44	-0.35	
(ii)		*Dolari SUA*	-0.35	-0.57	
(iii)		*Ruble ruseşti*	-0.01	-0.04	
(iv)		*Lei românești*	0.00	0.00	
(v)		*Alte valute străine*	0.00	-0.03	

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://www.bnm.md/ro/content/activele-si-obligatiunile-valutare-ale-bancilor-licentiate-pentru-luna-decembrie-2017

Legături conexe:

[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/ro/search?hashtags[0]=raportul pozitiei valutare [4] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=credite in valuta [5] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=depozite in valuta [6] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=active bilantiere [7] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=obligatiuni bilantiere [8] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=Active valutare [9] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=obligaţiuni valutare [10] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=poziţia valutară deschisă a băncilor [11] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=obligaţiuni condiţionale