Publicat pe (https://bnm.md)

22.08.2017

Activele și obligațiunile valutare ale băncilor licențiate in luna iulie 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 iulie 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)**	**29,603,698,609**	**28,987,378,009**	**100.0%**
	Total active valutare bilanţiere (A.1+A.3)	**29,059,997,026**	**28,371,777,420**	**97.9%**
A.1	**Total active bilanţiere în valută straină**	**27,975,916,669**	**27,302,578,227**	**94.2%**
	inclusiv pe categorii			
1	Disponibilităţi în valută străină	11,697,476,297	10,958,098,729	37.8%
(i)	Numerar	2,771,497,211	2,594,993,180	9.0%
(ii)	Conturi "Nostro" deschise în străinătate	6,896,690,728	6,500,867,032	22.4%
(iii)	Plasări în străinătate ale băncilor licenţiate	1,221,637,869	1,335,345,813	4.6%
(iv)	Mijloace plasate şi credite overnight	789,456,289	508,746,585	1.7%
(v)	Valori mobiliare	18,194,200	18,146,119	0.1%
2	Credite acordate în valută străină	14,020,114,579	13,946,279,490	48.1%
3	Rezerve obligatorii în valută străină plasate în BNM	3,489,852,993	3,450,882,459	11.9%
4	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-1,884,770,611	-1,836,026,001	-6.3%
5	Alte active în valută străină (A1-1-2-3-4)	653,243,411	783,343,550	2.7%
A.2	**Total active condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)**	**543,701,583**	**615,600,589**	**2.1%**
	inclusiv pe categorii			

	inclusiv pe categorii			
1	Cumpărari la operaţiuni la termen în valută străină	150,303,488	115,790,026	0.4%
2	Alte active condiţionale în valută străină	393,398,095	499,810,563	1.7%
A.3	**Total active ataşate la cursul valutei străine**	**1,084,080,357**	**1,069,199,193**	**3.7%**
	inclusiv pe categorii			
1	Credite acordate ataşate	1,172,754,893	1,157,487,142	4.0%
2	Ajustari si reduceri pentru pierderi din depreciere	-97,966,526	-97,241,175	-0.3%
3	Alte active ataşate (A3-1-2)	9,291,990	8,953,226	0.0%
B.	**Total obligaţiuni valutare (B.1+B.2+B.3)**	**29,352,107,331**	**28,940,564,891**	**100.0%**
	Total obligaţiuni valutare bilanţiere (B.1+B.3)	28,823,753,800	28,265,655,180	97.7%
B.1	**Total obligaţiuni bilanţiere în valută străină**	**28,823,697,441**	**28,265,599,953**	**97.7%**
	inclusiv pe categorii			
1	Conturi "Loro" în valută străină ale băncilor din străinătate	2,204,507	1,765,245	0.0%
2	Depozite la termen în valută străină ale băncilor din străinătate	182,580	182,331	0.0%
3	Conturi curente în valută străină ale clienţilor	8,479,435,108	8,087,370,588	28.0%
4	Depozite la termen în valută străină ale clienţilor	13,820,186,647	13,692,082,796	47.3%
5	Depozite diverse în valută străină ale clienţilor	3,619,667,190	3,587,997,841	12.4%
6	Credite primite în valută străină	2,349,633,958	2,344,425,488	8.1%
7	Ajustări	-5,258,751	-5,301,621	0.0%
8	Alte obligaţiuni bilanţiere în valută străină (B1-1-2-3-4-5-6-7)	557,646,202	557,077,286	1.9%
B.2	**Total obligaţiuni condiţionale în valută străină (extrabilanţiere)**	**528,353,531**	**674,909,711**	**2.3%**
	inclusiv pe categorii			
1	Vânzări la operaţiuni la termen în valută străină	150,615,308	123,643,796	0.4%
2	Alte obligaţiuni condiţionale în valută străină	377,738,223	551,265,915	1.9%
B.3	**Total obligaţiuni ataşate la cursul valutei străine**	**56,359**	**55,227**	**0.0%**
	inclusiv pe categorii			

	inclusiv pe categorii			
	Credite primite atașate	0	0	0.0%
	Alte obligaţiuni atașate	56,359	55,227	0.0%
C.	Mărimea poziţiei valutare deschise			
1	Lungi	339,925,139	213,813,970	100.0%
(i)	Euro	152,174,040	88,256,670	41.3%
(ii)	Dolari SUA	151,539,323	96,333,222	45.1%
(iii)	Ruble ruseşti	15,081,967	10,413,365	4.9%
(iv)	Lei românești	11,880,086	10,805,464	5.0%
(v)	Alte valute străine	9,249,723	8,005,250	3.7%
2	Scurte	-88,333,850	-167,045,153	100.0%
(i)	Euro	-32,692,081	-62,994,011	37.7%
(ii)	Dolari SUA	-52,654,656	-95,929,854	57.4%
(iii)	Ruble ruseşti	-643,190	-3,840,107	2.3%
(iv)	Lei românești	-1,262,047	-453,988	0.3%
(v)	Alte valute străine	-1,081,876	-3,827,194	2.3%
D.	Capital normativ total	9,882,809,827	9,957,659,277	
E.	Raportul poziţiei valutare deschise (%)			
1	Lungi			
(i)	Euro	1.54	0.89	
(ii)	Dolari SUA	1.53	0.97	
(iii)	Ruble ruseşti	0.15	0.11	
(iv)	Lei românești	0.12	0.11	
(v)	Alte valute străine	0.09	0.08	
2	Scurte			
(i)	Euro	-0.33	-0.63	
(ii)	Dolari SUA	-0.53	-0.96	
(iii)	Ruble ruseşti	-0.01	-0.04	
(iv)	Lei românești	-0.01	0.00	
(v)	Alte valute străine	-0.01	-0.04	

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-iulie-2017

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