

31 gennaio 2012

**LE RISERVE UFFICIALI
E LA LIQUIDITÀ IN VALUTA ESTERA
DELL'ITALIA ***

(*) I dati pubblicati in questo prospetto statistico sono compilati secondo le definizioni e i metodi previsti dallo standard di diffusione delle statistiche (SDDS) promosso dal Fondo monetario internazionale (cfr. la relativa Guida di compilazione, disponibile sul sito Internet: dsbb.imf.org).

Banca d'Italia - Riserve ufficiali e liquidità in valuta estera alla fine di dicembre 2011 / milioni di euro

I. RISERVE UFFICIALI E ALTRE ATTIVITA' IN VALUTA ESTERA (approssimate al valore di mercato)

A. Riserve Ufficiali	133.937
(1) Riserve in valuta estera (valute convertibili)	26.399
(a) titoli	24.396
<i>di cui:</i> emessi da filiali all'estero di residenti nell'area dell'euro	0
—azioni	166
—titoli di debito	23.045
—strumenti del mercato monetario	1.185
(b) valute e depositi con:	2.004
(i) altre banche centrali, BRI e FMI	1.268
(ii) banche con casa madre nell'area dell'euro	340
<i>di cui:</i> residenti al di fuori dell'area dell'euro	340
(iii) banche con casa madre al di fuori dell'area dell'euro	395
<i>di cui:</i> residenti nell'area dell'euro	0
(2) posizione di riserva verso l'FMI	4.516
(3) DSP	7.098
(4) oro (inclusi depositi in oro e, nel caso, oro <i>swapped</i>)	95.924
—quantità di oro in milioni di once troy	79
(5) altre attività di riserva	0
—derivati	0
—prestiti a operatori non bancari non residenti	0
—altre	0
B. Altre attività in valuta estera	2.835
—titoli non inclusi nelle riserve ufficiali	302
—depositi non inclusi nelle riserve ufficiali	2.594
—prestiti non inclusi nelle riserve ufficiali	0
—derivati non inclusi nelle riserve ufficiali	-61
—oro non incluso nelle riserve ufficiali	0
—altre	0

II. USCITE FUTURE NETTE A BREVE TERMINE DI VALUTA ESTERA: PREDETERMINATE (valore nominale)

		Totale	Scadenza (vita residua)		
			fino a 1 mese	da 1 a 3 mesi	da 3 mesi a 1 anno
1. Prestiti, titoli e depositi in valuta estera		-2	-2	0	0
—uscite (-)	capitale	-2	-2	0	0
	interessi	0	0	0	0
—entrate (+)	capitale	0	0	0	0
	interessi	0	0	0	0
2. Posizioni in forward e future in valuta estera contro euro (inclusi forward currency swap)		-1.548	0	-1.548	0
(a) posizioni corte (-)		-1.548	0	-1.548	0
(b) posizioni lunghe (+)		0	0	0	0
3. Altro		-1.710	-3.256	1.546	0
—uscite relative a p/t (-)		0	0	0	0
—entrate relative a p/t (+)		0	0	0	0
—crediti commerciali (-)		0	0	0	0
—crediti commerciali (+)		0	0	0	0
—altri saldi da pagare (-)		-3.286	-3.286	0	0
—altri saldi da incassare (+)		1.576	30	1.546	0

Italia - Amministrazione centrale (1) - Liquidità in valuta estera alla fine di dicembre 2011 / milioni di euro

II. USCITE FUTURE NETTE A BREVE TERMINE DI VALUTA ESTERA: PREDETERMINATE (valore nominale)

		Total	Scadenza (vita residua)		
			Up to 1 month	More than 1 and up to 3 months	More than 3 months and up to 1 year
1. Prestiti, titoli e depositi in valuta estera		-1.625	-305	-446	-874
—uscite (-)	capitale	-5.668	0	-1.159	-4.509
	interessi	-1.625	-305	-446	-874
—entrate (+)	capitale	5.668	0	1.159	4.509
	interessi				
2. Posizioni in forward e future in valuta estera contro euro (inclusi forward currency swap)		1.516	305	391	820
(a) posizioni corte (-)		-1	0	-1	-1
(b) posizioni lunghe (+)		1.517	305	392	820
3. Altro					
—uscite relative a p/t (-)					
—entrate relative a p/t (+)					
—crediti commerciali (-)					
—crediti commerciali (+)					
—altri saldi da pagare (-)					
—altri saldi da incassare (+)					

(1) Dati di competenza del Ministero dell'Economia e delle Finanze, pubblicati come da quest'ultimo trasmessi.

Banca d'Italia - Riserve ufficiali e liquidità in valuta estera alla fine di dicembre 2011 / milioni di euro

III. USCITE FUTURE NETTE A BREVE TERMINE DI VALUTA ESTERA: POTENZIALI (valore nominale)

	Totale	Scadenza (vita residua)		
		fino a 1 mese	da 1 a 3 mesi	da 3 mesi a 1 anno
1. Passività potenziali in valuta estera	0	0	0	0
(a) garanzie collaterali su debiti che scadono entro l'anno	0	0	0	0
(b) altre passività potenziali	0	0	0	0
2. Titoli in valuta estera emessi con opzione (con opzione di rivendita)	0			
3.1 Scoperti su linee di credito incondizionate concessi da:	0	0	0	0
(a) altre autorità monetarie nazionali, BRI, FMI e altre organizzazioni internazionali	0	0	0	0
—altre autorità monetarie nazionali (+)	0	0	0	0
—BRI (+)	0	0	0	0
—FMI (+)	0	0	0	0
—altre organizzazioni internazionali (+)	0	0	0	0
(b) banche e altre istituzioni finanziarie con casa madre nell'area dell'euro (+)	0	0	0	0
(c) banche e altre istituzioni finanziarie con casa madre fuori dell'area dell'euro (+)	0	0	0	0
3.2 Scoperti su linee di credito incondizionate concessi a:	0	0	0	0
(a) altre autorità monetarie nazionali, BRI, FMI e altre organizzazioni internazionali	0	0	0	0
—altre autorità monetarie nazionali (-)	0	0	0	0
—BRI (-)	0	0	0	0
—FMI (-)	0	0	0	0
—altre organizzazioni internazionali (-)	0	0	0	0
(b) banche e altre istituzioni finanziarie con casa madre nell'area dell'euro (-)	0	0	0	0
(c) banche e altre istituzioni finanziarie con casa madre fuori dall'area dell'euro (-)	0	0	0	0
4. Posizioni corte e lunghe in opzioni in valuta estera contro euro	0	0	0	0
(a) posizioni corte	0	0	0	0
(i) put acquistate	0	0	0	0
(ii) call sottoscritte	0	0	0	0
(b) posizioni lunghe	0	0	0	0
(i) call acquistate	0	0	0	0
(ii) put sottoscritte	0	0	0	0
PRO MEMORIA: opzioni "in the money"				
(1) Al tasso di cambio corrente	0	0	0	0
(a) posizioni corte	0	0	0	0
(b) posizioni lunghe	0	0	0	0
(2) + 5 % (deprezzamento del 5%)	0	0	0	0
(a) posizioni corte	0	0	0	0
(b) posizioni lunghe	0	0	0	0
(3) - 5 % (apprezzamento del 5%)	0	0	0	0
(a) posizioni corte	0	0	0	0
(b) posizioni lunghe	0	0	0	0
(4) +10 % (deprezzamento del 10%)	0	0	0	0
(a) posizioni corte	0	0	0	0
(b) posizioni lunghe	0	0	0	0
(5) - 10 % (apprezzamento del 10%)	0	0	0	0
(a) posizioni corte	0	0	0	0
(b) posizioni lunghe	0	0	0	0
(6) Altro	0	0	0	0
(a) posizioni corte	0	0	0	0
(b) posizioni lunghe	0	0	0	0

IV. PER MEMORIA

1. Dati mensili	
(a) debiti in euro a breve termine indicizzati al tasso di cambio	0
(b) strumenti finanziari denominati in valuta estera e regolati in modo diverso	0
—derivati (forward, futures e opzioni)	0
—posizioni corte	0
—posizioni lunghe	0
—altri strumenti	0
(c) attività date in pegno	0
—incluse nelle riserve ufficiali	0
—incluse nelle altre attività in valuta estera	0
(d) titoli prestati e a garanzia di operazioni p/t	21
—prestati o ceduti p/t inclusi nella sez. I (-)	0
—prestati o ceduti p/t non inclusi nella sez. I (-)	0
—ottenuti in prestito o acquistati p/t inclusi nella sezione I (+)	0
—ottenuti in prestito o acquistati p/t non inclusi nella sezione I (+)	21
(e) attività in derivati (nette, al mercato)	-61
—forward	0
—futures	0
—swap	-61
—opzioni	0
—altre	0
(f) derivati (forward, futures, opzioni) con vita residua maggiore di 1 anno	0
—posizioni corte e lunghe in forward e futures in valuta estera contro euro (incluso il forward dei currency swap)	0
(a) posizioni corte (-)	0
(b) posizioni lunghe (+)	0
—posizioni corte e lunghe in opzioni in valuta estera contro euro	0
(a) posizioni corte	0
(i) put acquistate	0
(ii) call sottoscritte	0
(b) posizioni lunghe	0
(i) call acquistate	0
(ii) put sottoscritte	0
2. Dati trimestrali	
(a) composizione in valuta delle riserve (per gruppi di valute)	133.937
—nel paniere DSP	128.531
—fuori dal paniere DSP	5.406