

30 dicembre 2011

**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).

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

| | |
|--|---------|
| A. Riserve Ufficiali | 138.837 |
| (1) Riserve in valuta estera (valute convertibili) | 25.392 |
| (a) titoli | 23.388 |
| <i>di cui:</i> emessi da filiali all'estero di residenti nell'area dell'euro | 0 |
| —azioni | 160 |
| —titoli di debito | 22.174 |
| —strumenti del mercato monetario | 1.053 |
| (b) valute e depositi con: | 2.004 |
| (i) altre banche centrali, BRI e FMI | 1.202 |
| (ii) banche con casa madre nell'area dell'euro | 344 |
| <i>di cui:</i> residenti al di fuori dell'area dell'euro | 344 |
| (iii) banche con casa madre al di fuori dell'area dell'euro | 458 |
| <i>di cui:</i> residenti nell'area dell'euro | 0 |
| (2) posizione di riserva verso l'FMI | 3.912 |
| (3) DSP | 6.959 |
| (4) oro (inclusi depositi in oro e, nel caso, oro <i>swapped</i>) | 102.575 |
| —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 | 1.332 |
| —titoli non inclusi nelle riserve ufficiali | 303 |
| —depositi non inclusi nelle riserve ufficiali | 1.029 |
| —prestiti non inclusi nelle riserve ufficiali | 0 |
| —derivati non inclusi nelle riserve ufficiali | 0 |
| —oro non incluso nelle riserve ufficiali | 0 |
| —altre | 0 |

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

| | | Scadenza (vita residua) | | | |
|--|-----------|-------------------------|---------------|---------------|--------------------|
| | | Totale | 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) | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (a) posizioni corte (-) | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (b) posizioni lunghe (+) | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3. Altro | | -3.045 | -3.045 | 0 | 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 (-) | | -3.072 | -3.072 | 0 | 0 |
| —altri saldi da incassare (+) | | 27 | 27 | 0 | 0 |

Italia - Amministrazione centrale (1) - Liquidità in valuta estera alla fine di novembre 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 | | -1.571 | -294 | -432 | -846 |
| —uscite (-) | capitale | -5.475 | 0 | -1.118 | -4.357 |
| | interessi | -1.571 | -294 | -432 | -846 |
| —entrate (+) | capitale | 5.475 | 0 | 1.118 | 4.357 |
| | interessi | | | | |
| 2. Posizioni in forward e future in valuta estera contro euro (inclusi forward currency swap) | | 1.466 | 294 | 379 | 793 |
| (a) posizioni corte (-) | | -1 | 0 | -1 | -1 |
| (b) posizioni lunghe (+) | | 1.467 | 294 | 379 | 794 |
| 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 novembre 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 | 204 |
| —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 (+) | 204 |
| (e) attività in derivati (nette, al mercato) | 0 |
| —forward | 0 |
| —futures | 0 |
| —swap | 0 |
| —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 |