

AVOIRS DE RESERVES ET DISPONIBILITES EN DEVISES AU 30 AVRIL 2012

(en Ms EUR)

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------------|-------------------------|
| I - Avoirs de réserve officiels et autres avoirs en devises | 160053 | | | |
| <u>A - Avoirs de réserve officiels</u> | 136341 | | | |
| 1) Réserves en devises (convertibles) | 19962 | | | |
| a) Titres | 18407 | | | |
| b) Dépôts bancaires totaux | 1555 | | | |
| i) auprès d'autres banques centrales et de la BRI | 271 | | | |
| ii) auprès de banques dont le siège est dans la zone euro dont établissements situés hors de la zone euro | 33 | | | |
| iii) auprès de banques dont le siège est hors de la zone euro | 1251 | | | |
| 2) Position de réserve au FMI | 6516 | | | |
| 3) Avoirs en DTS | 11158 | | | |
| 4) Avoirs en or (y compris or prêté) | 98368 | | | |
| 5) Autres avoirs de réserve | 337 | | | |
| <u>B - Autres avoirs en devises</u> | 23712 | | | |
| - titres non inclus dans les avoirs de réserves officiels | 8308 | | | |
| - dépôts non inclus dans les avoirs de réserves officiels | 15404 | | | |
| | Total | <i>Décomposition par échéance</i> | | |
| | | <i>(durée résiduelle, selon le cas)</i> | | |
| | | <i>1 mois au plus</i> | <i>de 1 à 3 mois</i> | <i>de 3 mois à 1 an</i> |
| II - Sorties temporaires d'actifs financiers en devises | - 10085 | - 9548 | - 537 | - |
| 1) Emprunts et titres en devises | - | - | - | - |
| 2) Positions à terme agrégées en devises contre euro courtes et longues | - 1597 | - 1060 | - 537 | - |
| a) positions courtes | - 1597 | - 1060 | - 537 | - |
| b) positions longues | - | - | - | - |
| 3) Autres (sorties liées aux mises en pension de titres) | - 8488 | - 8488 | - | - |
| III - Sorties nettes potentielles de devises à court terme | - | - | - | - |
| 1) Dettes potentielles en devises | - | - | - | - |
| a) engagements de garantie sur dettes venant à échéance dans un an au plus | - | - | - | - |
| b) autres dettes potentielles | - | - | - | - |
| 2) Titres en devises assortis d'options à l'émission | - | - | - | - |
| 3) Engagements de financement irrévocables non utilisés | - | - | - | - |
| a) en faveur d'autres banques centrales | - | - | - | - |
| b) en faveur de banques et autres institutions financières dont le siège est dans la zone euro | - | - | - | - |
| c) en faveur de banques et autres institutions financières dont le siège est en dehors de la zone euro | - | - | - | - |
| 4) Positions d'options agrégées en devises contre euro courtes et longues | - | - | - | - |
| a) positions courtes | - | - | - | - |
| -puts achetés | - | - | - | - |
| -calls vendus | - | - | - | - |
| b) positions longues | - | - | - | - |
| -calls achetés | - | - | - | - |
| -puts vendus | - | - | - | - |
| Pour mémoire : options dans la monnaie | - | - | - | - |
| 1) aux cours de change du jour | - | - | - | - |
| a) position courte | - | - | - | - |
| b) position longue | - | - | - | - |
| 2) +5% (appréciation de 5%) | - | - | - | - |
| a) position courte | - | - | - | - |
| b) position longue | - | - | - | - |
| 3) -5% (dépréciation de 5%) | - | - | - | - |
| a) position courte | - | - | - | - |
| b) position longue | - | - | - | - |
| 4) +10% | - | - | - | - |
| a) position courte | - | - | - | - |
| b) position longue | - | - | - | - |
| 5) -10% | - | - | - | - |
| a) position courte | - | - | - | - |
| b) position longue | - | - | - | - |
| IV - Postes pour mémoire | | | | |
| a) dette à court terme en euro indexée sur le cours de change | - | | | |
| b) instruments financiers libellés en devises et réglés autrement (par exemple en euros) | - | | | |
| c) actifs engagés | - | | | |
| d) titres prêtés et donnés en pension | - 8045 | | | |
| - prêtés ou donnés en pension et compris dans la section I | - 8488 | | | |
| - empruntés ou pris en pension et non compris dans la section I | 443 | | | |
| e) actifs financiers dérivés (net, en valeur de marché) | - | | | |
| f) produits dérivés (opérations et contrats à terme, contrats d'options) à échéance résiduelle supérieure à un an et soumis à appels de marges | - | | | |