

AVOIRS DE RESERVES ET DISPONIBILITES EN DEVISES AU 31 MAI 2012

(en Ms EUR)

I - Avoirs de réserve officiels et autres avoirs en devises	163015			
A - Avoirs de réserve officiels	138256			
1) Réserves en devises (convertibles)	21334			
a) Titres	19665			
b) Dépôts bancaires totaux	1669			
i) auprès d'autres banques centrales et de la BRI	312			
ii) auprès de banques dont le siège est dans la zone euro <i>dont établissements situés hors de la zone euro</i>	33			
iii) auprès de banques dont le siège est hors de la zone euro	1324			
2) Position de réserve au FMI	6760			
3) Avoirs en DTS	11499			
4) Avoirs en or (y compris or prêté)	98234			
5) Autres avoirs de réserve	429			
B - Autres avoirs en devises	24759			
- titres non inclus dans les avoirs de réserves officiels	8314			
- dépôts non inclus dans les avoirs de réserves officiels	16445			
	Total	<i>Décomposition par échéance (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	- 11210	- 9880	- 1330	-
1) Emprunts et titres en devises	-	-	-	-
2) Positions à terme agrégées en devises contre euro courtes et longues	- 1378	- 48	- 1330	-
a) positions courtes	- 1378	- 48	- 1330	-
b) positions longues	-	-	-	-
3) Autres (sorties liées aux mises en pension de titres)	- 9832	- 9832	-	-
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	- 9355			
- prêtés ou donnés en pension et compris dans la section I	- 9832			
- empruntés ou pris en pension et non compris dans la section I	477			
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	-			