

Reservas Internacionales y Liquidez en Moneda Extranjera

Los cuadros adjuntos recogen la información sobre saldos de los activos de reserva españoles que ya viene publicándose en el Boletín Estadístico y en los Indicadores y, además, información sobre otros activos y pasivos, incluidos los pasivos contingentes, del Banco de España, o del Tesoro Público, denominados en moneda extranjera. Esta información se ha elaborado de acuerdo con las normas metodológicas publicadas por el Fondo Monetario Internacional en el documento “Data Template on International Reserves and Foreign Currency Liquidity. Operational Guidelines”, 2013 (<https://www.imf.org/external/np/sta/ir/IRProcessWeb/pdf/guide2013.pdf>)

Reservas Internacionales y Liquidez en Moneda Extranjera 1

ESPAÑA

Saldos a 31 de agosto de 2020

I. Activos de Reserva y otros activos en moneda extranjera (valor de mercado aproximado)

Millones de euros

	Banco de España	Tesoro Público
A. Activos de Reserva	67.463	
Divisas convertibles	46.675	
Valores	36.874	
de los que: valores en repo	-	
de los que: sede del emisor en el país declarante	-	
Acciones y fondos de Inversión	90	
Bonos y obligaciones	34.466	
Instrumentos de mercado monetario	2.318	
Moneda y depósitos:	9.802	
frente a otros bancos centrales, BPI y FMI	6.677	
frente a bancos	3.125	
frente a bancos con sede en el país declarante	1	
de los que: domiciliados en el extranjero	1	
frente a bancos con sede fuera del país declarante	3.124	
de los que: domiciliados en el país declarante	-	
Posición de reserva en el FMI	2.406	
DEG	3.003	
Oro monetario	14.905	
<i>del cual: oro en préstamo</i>	-	
Lingotes de oro	13.964	
volumen en millones de onzas troy	8	
Cuentas no asignadas	940	
volumen en millones de onzas troy	1	
Otros activos de reserva	474	
derivados financieros	-6	
préstamos al sector no bancario no residente	480	
otros	-	
B. Otros activos en moneda extranjera	6.902	-
valores no incluidos en Activos de Reserva	985	-
depósitos no incluidos en Activos de Reserva	5.770	-
de los que: sede en el país declarante o en la zona euro	4.058	-
de los que: sede fuera del el país declarante o de la zona euro	1.712	-
préstamos no incluidos en Activos de Reserva	-	-
derivados financieros no incluidos en Activos de Reserva	147	-
oro no incluido en Activos de Reserva	-	-
otros	-	-

1 Elaborado de acuerdo con las nuevas normas metodológicas publicadas por el FMI en el documento 'Data Template on International Reserves and Foreign Currency Liquidity. Operational Guidelines', 2013 (<https://www.imf.org/external/np/sta/ir/IRProcessWeb/pdf/guide2013.pdf>)

II. Drenajes de liquidez predeterminados netos a corto plazo en moneda extranjera (valor nominal)

Millones de euros

	Total		Vencimientos residuales					
			Hasta 1 mes		Más de 1 mes y hasta 3 meses		Más de 3 meses y hasta 1 año	
	Banco de España	Tesoro Público	Banco de España	Tesoro Público	Banco de España	Tesoro Público	Banco de España	Tesoro Público
1. Préstamos, valores y depósitos en moneda extranjera	-1	-29	-1	-	0	-13	0	-16
Salidas (-) Principal	-1	-	-1	-	-	-	-	-
Intereses	-	-29	-	-	-	-13	-	-16
Entradas (+) Principal	-	-	-	-	-	-	-	-
Intereses	0	-	-	-	0	-	0	-
2. Posiciones cortas y largas de los contratos a plazo y de los futuros financieros en moneda extranjera contra moneda local (incluida la parte a plazo de los swaps de divisas)	-2.934	17	-2.431	-	-503	13	-	5
Posiciones cortas (-)	-2.934	-	-2.431	-	-503	-	-	-
Posiciones largas (+)	-	17	-	-	-	13	-	5
3. Otros	-5.867	-	-2.933	-	-2.431	-	-503	-
Drenajes relacionados con operaciones repo (-)	-5.867	-	-2.934	-	-2.431	-	-503	-
Drenajes relacionados con operaciones repo comprador (+)	-	-	-	-	-	-	-	-
Crédito comercial (-)	-	-	-	-	-	-	-	-
Crédito comercial (+)	-	-	-	-	-	-	-	-
Otras cuentas a pagar (-)	-	-	-	-	-	-	-	-
Otras cuentas a cobrar (+)	0	-	0	-	-	-	-	-

IV. Pro-memoria

Millones de euros

	Banco de España	Tesoro Público
1. Deuda a corto plazo en moneda local referenciada al tipo de cambio	-	-
2. Instrumentos financieros denominados en moneda extranjera y liquidados con otros medios de pago (e.g., en moneda local)	-	-
Derivados (contratos a plazo, futuros financieros y opciones)	-	-
posiciones cortas	-	-
posiciones largas	-	-
Otros instrumentos	-	-
3. Activos en garantía	-	-
incluidos en Activos de Reserva	-	-
incluidos en Otros Activos en Moneda Extranjera	-	-
4. Valores cedidos o adquiridos en préstamo o repo	-	-
cedidos e incluidos en la Sección I	-	-
cedidos y no incluidos en la Sección I	-	-
adquiridos e incluidos en la Sección I	-	-
adquiridos y no incluidos en la Sección I	-	-
5. Derivados financieros (neto, valor de mercado)	141	9
contratos a plazo	-	-
futuros financieros	-	-
swaps	141	9
opciones	-	-
otros	-	-
6. Derivados financieros (contratos a plazo, futuros y opciones) con vencimiento residual mayor a un año	-	-
financieros en moneda extranjera contra moneda local (incluida la parte a plazo de los swaps de divisas)	-	-
posiciones cortas (-)	-	-
posiciones largas (+)	-	-
Posiciones cortas y largas en opciones en moneda extranjera contra	-	-
posiciones cortas	-	-
opciones de venta adquiridas	-	-
opciones de compra vendidas	-	-
posiciones largas	-	-
opciones de compra adquiridas	-	-
opciones de venta vendidas	-	-
7. Composición por monedas de las Reservas (por grupos de monedas)	67.463	-
monedas en cesta SDR	61.189	-
monedas no en cesta SDR	6.274	-