

Note:

Il valore di mercato (MTM) non include le elaborazioni statistiche operate dalla Banca d'Italia al fine della pubblicazione dei conti finanziari.

Strumenti derivati su debito - dati in €mln

Strumento	Nozionale	in %	MTM	in %
CCS (Cross Currency Swap)	21.329	13,37%	1.093	-2,60%
IRS (Interest Rate Swap) di copertura	12.309	7,71%	643	-1,53%
IRS (Interest Rate Swap) di duration	102.948	64,51%	-33.087	78,66%
IRS ex-ISPA	3.500	2,19%	-1.524	3,62%
Swaption	19.500	12,22%	-9.188	21,84%
Totale derivati su debito	159.586	100,00%	-42.064	100,00%
Titoli di Stato in circolazione	1.782.233			
Derivati su debito/Titoli di Stato	8,95%			

Strumenti derivati su attivi (legge finanziaria per il 2005)

Strumento	Nozionale	MTM
IRS (Interest Rate Swap)	3.454	-586

Portafoglio strumenti derivati complessivo

Strumento	Nozionale	in %	MTM	in %
Derivati su debito	159.586	97,88%	-42.064	98,63%
Derivati su attivi	3.454	2,12%	-586	1,37%
Totale strumenti derivati	163.040	100,00%	-42.649	100,00%

Contratti con clausole di estinzione anticipata con scadenza tra il 2015 e il 2038 - dati in €mln

Strumento	Nozionale	in %	MTM	in %
IRS e Swaption	16.200	9,94%	-9.338	21,90%

Di cui:

Strumento	Nozionale	in %	MTM	in %
2015	200	0,12%	18	-0,04%
2016	2.000	1,23%	-855	2,00%
2017	0	0,00%	0	0,00%
2018	2.500	1,53%	-1.772	4,15%
2019-2022	0	0,00%	0	0,00%

Tutto il resto dal 2023 al 2038