

KILDER OG METODER

INTERNATIONALE RESERVEAKTIVER OG LIKVIDITET

Finansiell Statistik
Værdipapir- og betalingsbalancestatistik

Senest revideret:
03-04-2017

INTERNATIONALE RESERVEAKTIVER OG LIKVIDITET

- 0 Administrative oplysninger om statistikproduktet
- 1 Indhold
- 2 Tid
- 3 Pålidelighed og usikkerhed
- 4 Sammenlignelighed
- 5 Tilgængelighed
- 6 Supplerende dokumentation

0 ADMINISTRATIVE OPLYSNINGER OM STATISTIKPRODUKTET

0.1 NAVN

Internationale reserveaktiver og likviditet - IMF-opgørelse.

0.2 Emnegruppe

Internationale reserveaktiver og likviditet.

0.3 Ansvarlig myndighed, kontor, person mv.

Danmarks Nationalbank, Finansiell Statistik, Publicering

Robert Wederkinck, tlf. 33 63 68 63, e-mail: rwe@nationalbanken.dk

Christian Brauer Johanssen, tlf. 33 63 65 93, e-mail: cbjo@nationalbanken.dk

0.4 Formål og historie

Indsamles som led i Den Internationale Valutafonds (IMF) overvågning af centralbankernes balancer med henblik på at vurdere risikoen for finansielle kriser. Nationalbanken er forpligtet til at offentliggøre denne opgørelse af reserveaktiver, fordi Danmark har tilsluttet sig den internationale datapubliceringsstandard SDDS (Special Data Dissemination Standard).

0.5 Brugere og anvendelsesområder

IMF, pengeinstitutter, interesseorganisationer.

0.6 Kilder

Statistikken udarbejdes på grundlag af oplysninger fra Nationalbankens bank- og markedsafdeling samt månedlige indberetninger fra de statsgaranterede enheder. Disse omfatter A/S Storebæltsforbindelsen, A/S Øresundsforbindelsen, Øresundsbro Konsortiet og indtil udgangen af 2005 Hypotekbanken, der på nævnte tidspunkt blev nedlagt og overført til staten.

0.7 Indsamlingshjemmel

Nationalbanken indsamler oplysningerne i medfør af Nationalbanklovens §14 a indsat ved lov nr. 579 af 1. juni 2010, ifølge hvilken Nationalbanken indsamler, bearbejder og offentliggør statistiske oplysninger inden for dens kompetenceområde. De indsamlede oplysninger kan anvendes til andet end statistikudarbejdelse. Det gælder særligt i forbindelse med overvågningen af den finansielle stabilitet og ved tilrettelæggelsen af penge- og valutapolitikken, samt i relation til Nationalbankens deltagelse i det europæiske samarbejde på det finansielle område.

0.8 Respondentbyrde

Den væsentligste respondentbyrde er pålagt de statsgaranterede enheder, der på månedsbasis rapporterer oplysninger vedrørende betalinger og balance.

0.9 EU-regulering

Ingen.

1 INDHOLD

1.1 Indholdsbeskrivelse

Statistikken er en mere detaljeret opgørelse af Nationalbankens reserveaktiver end i den månedlige pressemeddelelse.

Tallene er opgjort i henhold til IMF's retningslinjer for opgørelse af internationale reserveaktiver (Data Template on International Reserve Assets and Foreign Currency Liquidity). Opgørelsen afviger på flere punkter fra den opgørelse, som fremgår af Nationalbankens regnskabsmæssige balance. Den er både mere omfangsrig og opgøres efter andre principper. Ud over Nationalbankens valutaaktiver omfatter den udvidede opgørelse oplysninger om fremtidige ind- og udbetalinger på valutaaktiver og -passiver, herunder også udbetalinger på statens valutapassiver, samt

supplerende oplysninger om fx valutaaktiver, der er modtaget eller stillet som sikkerhed af Nationalbanken.

1.2 Statistiske begreber

Markedsværdi

Opgørelse til markedsværdi indebærer, at aktiver og passiver reguleres med gældende markedskurser på opgørelsestidspunktet, samt at tilgodehavende renter inkluderes i opgørelsen. Guld er optaget til den senest officielt noterede guldpris i London ved månedens slutning.

Køb og salg af valuta på termin

Nationalbankens køb og salg af valuta på termin er inkluderet under "Positioner i forwards, futures og swaps", mens fx uafviklede spotforretninger er inkluderet under "Øvrige".

SDR-valutaer

SDR-valutaer er p.t.: Amerikanske dollar, euro, japanske yen og britiske pund.

2 TID

2.1 Referencetid

Statistikken opgøres på månedsbasis.

2.2 Udgivelsestid

Offentliggøres den sidste bankdag i måneden efter referenceperiodens afslutning.

2.3 Punktlighed

Offentliggørelsen sker normalt uden forsinkelser i forhold til det annoncerede offentliggørelsestidspunkt.

2.4 Hyppighed

Der offentliggøres nye tal hver måned.

3 PÅLIDELIGHED OG USIKKERHED

3.1 Samlet pålidelighed

Pålideligheden er generelt høj. Data er regnskabstal fra Nationalbankens bank- og markedsafdeling.

3.2 Usikkerhedskilder

Ingen.

3.3 Tal for usikkerhed

Der foretages ikke usikkerhedsberegninger.

4 SAMMENLIGNELIGHED

4.1 Sammenlignelighed over tid

Kan sammenlignes med IMF's SDDS-side på <http://dsbb.imf.org/Applications/web/dsbbhome/> og på <http://www.dst.dk/en/Statistik/IMF/Imf.aspx>.

4.2 Sammenlignelighed med anden statistik

Tallene er opgjort i henhold til IMF's retningslinjer for opgørelse af internationale reserveaktiver (Data Template on International Reserve Assets and Foreign Currency Liquidity). Opgørelsen afviger på flere punkter fra den opgørelse, som fremgår af Nationalbankens regnskabsmæssige balance. Den er både mere omfangsrig og opgøres efter andre principper. Ud over Nationalbankens valutaaktiver omfatter den udvidede opgørelse oplysninger om fremtidige ind- og udbetalinger på valutaaktiver og -passiver, herunder også udbetalinger på statens valutapassiver, samt supplerende oplysninger om fx valutaaktiver, der er modtaget eller stillet som sikkerhed af Nationalbanken.

Opgørelsen af Nationalbankens reserveaktiver afviger fra Valuta og likviditet samt månedsbalance, som er den officielle reserveaktivopgørelse i den regnskabsmæssige balance, og som offentliggøres den 2. hverdag i hver måned. Forskellen fremkommer på grund af følgende to forhold:

Valutareserveaktiver er i den regnskabsmæssige balance opgjort til bogført værdi, hvorimod de i denne opgørelse er opgjort til markedsværdi. Den heraf afledte forskel udgøres af "Kursregulering mv."

I den officielle opgørelse udledt af den regnskabsmæssige balance fratrækkes valutareserveaktiver desuden forpligtelser over for udlandet, jf. Nationalbankens statistik Specifikation til Nationalbankens balance.

4.3 Forhold mellem foreløbige og endelige tal

Der offentliggøres kun endelige tal.

5 TILGÆNGELIGHED

5.1 Distributionskanaler

Offentliggøres månedligt på:

www.nationalbanken.dk

<http://nationalbanken.statistikbank.dk>

www.statistikbanken.dk

5.2 Grundmateriale: Lagring og anvendelsesmuligheder

Materialet lagres i Nationalbankens statistisk afdelings database.

5.3 Dokumentation

Ingen.

5.4 Øvrige oplysninger

Der foreligger ikke yderligere oplysninger.

6 SUPPLERENDE DOKUMENTATION

Se mere information på <http://dsbb.imf.org/Applications/web/dsbbhome/>