

Metodický list

Metodika stanovování struktury devizových rezerv

I. Definice a obsah

Devizové rezervy zahrnují likvidní zahraniční aktiva České národní banky ve směnitelných měnách.

Mezi devizové rezervy řadíme monetární zlato (včetně zlatých depozit a zlata ze swapových operací), zvláštní práva čerpání, rezervní pozici u Mezinárodního měnového fondu (MMF) a ostatní rezervní aktiva (tj. oběživo a vklady, cenné papíry, finanční deriváty, ostatní pohledávky).

Devizové rezervy jsou vykazovány Českou národní bankou ve struktuře stanovené Mezinárodním měnovým fondem (*Guidelines for a Data Template on International Reserves and Foreign Currency Liquidity*) v souladu s manuálem BPM6 (*Balance of Payments and International Investment Position Manual, 6th edition*).

II. Zdroje a metodika zjišťování

Zdrojem pro získání definovaných dat jsou databáze ČNB. Struktura devizových rezerv se zpracovává v měsíční periodicitě a zveřejňuje se 7. den v měsíci na internetové stránce ČNB (předběžná data). Následující měsíc jsou tato předběžná data o struktuře devizových rezerv revidována.

III. Členění

Stav devizových rezerv a devizová likvidita se člení na 4 části:

1. Stav devizových rezerv a ostatních devizových aktiv
2. Předurčený krátkodobý odliv / příliv devizových aktiv
3. Podmíněný krátkodobý příliv/ odliv devizových aktiv
4. Ostatní vybrané položky

IV. Způsob výpočtu

Probíhá dle metodiky MMF.

V. Změna metodiky

Od října 2014 jsou devizové rezervy nově publikovány podle metodiky manuálu BPM6 v časové řadě od ledna 2013. Oproti manuálu BPM5 jsou nyní devizové rezervy vykazány na brutto bázi, včetně repo operací s cennými papíry.

VI. Vykazující subjekty

Česká národní banka