

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Název: Likvidita podle DA

Datová oblast: LIS11_11

Název: Likvidní aktiva - všechny mĚny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pĚhled likvidních aktiv, tj. aktiv, která splĚují požadavky danĚ hlavou II LCR DA. OdpovĚdĚ sloupcĚm 010 a 040 (sloupce 020 a 030 jsou potlaĚeny a v tĚto DO se nevykazují) tabulky L 72.00 jednotnĚho rĚmce pro reporting v oblasti likvidity. DetailnĚ popis pro vykazovĚnĚ informacĚ o likvidních aktivech - viz pĚiloha XXIII ěast 1 ITS.

PĚi vykazovĚnĚ hodnoty podle ěl. 9 LCR DA vykazujĚcĚ osoba uvĚdĚ tam, kde je to relevantnĚ, hodnotu likvidních aktiv po zohlednĚnĚ ěistĚho odtoku nebo pĚĚtoku likvidity, ke kterĚmu by došlo v pĚĚpadĚ pĚedĚasnĚho uzavĚenĚ zajišĚovacĚho vztahu podle ěl. 8 (5) LCR DA a v souladu s odpovĚdajĚcĚmi limity specifikovanĚmi v kapitole 2 LCR DA.

KaždĚ pološka aktiv mĚže bĚt zařazena pouze jednou, tj. vykazujĚcĚ osoba nesmĚ vykĚzat řĚdnou pološku dvakrĚt (s vĚjimkou doplĚkovĚch informacĚ).

VeškerĚ aktiva, která splĚují požadavky ěl. 7, 8 a 9 LCR DA a kterĚ mĚ vykazujĚcĚ osoba v drženĚ k datu vykazovĚnĚ, se vykazují na pĚĚsluřnĚch řĚdcĚch datovĚ oblasti, i kdyř byly prodĚny nebo pouřity v zajiřtĚnĚch forwardovĚch transakcĚch. Toto platĚ i obrĚcenĚ, tj. řĚdnĚ likvidnĚ aktiva nesmĚ bĚt vykĚzĚna v tĚto datovĚ oblasti, z forwardovĚch transakcĚ tĚkajĚcĚ se smluvnĚ odsouhlasenĚch, ale nevypodĚdanĚch nĚkupĚ likvidních aktiv a forwardovĚch nĚkupĚ likvidních aktiv.

Data se vykazují souhrnnĚ za všechny mĚny v pĚepoĚtu na CZK.

V popisu jednotlivĚch metodickĚch objektĚ jsou pouřity odkazy na nĚkterĚ evropskĚ pĚedpisy, pĚĚĚmř:

- LCR DA odkazuje na NařĚzenĚ Komise v pĚenesenĚ pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. řĚjna 2014, kterĚm se doplĚuje nařĚzenĚ EvropskĚho parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na ťvĚrovĚ instituce tĚkajĚcĚ se likvidity,
- CRR odkazuje na nařĚzenĚ EvropskĚho parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezĚtnostnĚch požadavcĚch na ťvĚrovĚ instituce a investicĚnĚ podniky,
- ITS odkazuje na provĚdicĚ nařĚzenĚ Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterĚm se stanovĚ provĚdicĚ technickĚ normy, pokud jde o podĚvĚnĚ zprĚv institucĚ pro ťĚely dohledu podle nařĚzenĚ EvropskĚho parlamentu a rady (EU) ě. 575/2013, ve znĚnĚ provĚdicĚho nařĚzenĚ komise (EU) 2016/322 ze dne 10. ťnora 2016, kterĚm se stanovĚ provĚdicĚ technickĚ normy, pokud jde o podĚvĚnĚ zprĚv institucĚ pro ťĚely dohledu v souvislosti s požadavkem krytĚ likvidity.

VĚĚet informaĚnĚch prvkv v datovĚ oblasti:

KĚd	NĚzev	DatovĚ typ ťdajĚ
LCR0600	NeupravenĚ likvidnĚ aktiva celkem	
LCR0601	NeupravenĚ aktiva ťrovnĚ 1 celkem	
LCR0602	NeupravenĚ aktiva ťrovnĚ 1 bez krytĚch dluhopisĚ mimořĚdnĚ v	
LCR0603	Hotovost (mĚnce a bankovky)	
LCR0604	ĚĚrpatelnĚ rezervy u centřĚlnĚ banky	
LCR0605	PohledĚvky vĚĚi centřĚlnĚm bankĚm	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0606	Pohledávky vůči ústředním vládám
LCR0607	Pohledávky vůči regionálním vládám a místním orgánům
LCR0608	Pohledávky vůči subjektům veřejného sektoru
LCR0609	Uznatelné pohledávky vůči ústřední vládě nebo centrální banc
LCR0610	Pohledávky vůči ÚI chráněným vládou členského státu a poskyt
LCR0611	Pohledávky vůči mezinárodním rozvojovým bankám a mezinárodní
LCR0612	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0613	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovně 1
LCR0614	Úvěrové přísliby od centrálních bank (alternativní likviditn
LCR0615	Aktiva úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvali
LCR0616	Aktiva úrovně 2A uznaná jako aktiva úrovně 1 (alternativní 1
LCR0617	Neupravené kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1
LCR0618	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality
LCR0619	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0620	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1 u ústřední
LCR0621	Neupravená aktiva úrovně 2 celkem
LCR0622	Neupravená aktiva úrovně 2A celkem
LCR0623	Pohledávky vůči regionálním vládám, místním orgánům a subjek
LCR0624	Pohledávky vůči centrálním bankám nebo ústředním a regionáln
LCR0625	Kryté dluhopisy vysoké kvality (stupeň úvěrové kvality 2)
LCR0626	Kryté dluhopisy vysoké kvality vydané ve třetích zemích (stu
LCR0627	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 1)
LCR0628	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovně 2A
LCR0629	Aktiva úrovně 2A u ústřední instituce považovaná za likvidní
LCR0630	Neupravená aktiva úrovně 2B celkem
LCR0631	Cenné papíry zajištěné úvěry na obytné nemovitostmi (stupeň
LCR0632	Cenné papíry zajištěné úvěry na financování motorových vozid
LCR0633	Kryté dluhopisy vysoké kvality s RV 35 %
LCR0634	Cenné papíry zajištěné podnikovými úvěry nebo úvěry fyzickým
LCR0635	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 2/3)
LCR0636	Neúročené podnikové dluhové CP držené ÚI z náboženských důvo
LCR0637	Akcie tvořící součást hlavního akciového indexu
LCR0638	Neúročená aktiva držená ÚI z náboženských důvodů (stupeň úvř
LCR0639	Závazné likviditní přísliby centrálních bank s omezeným použ
LCR0640	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0641	Akcie/podíly v subjektech kolektivního investování s podklad
LCR0642	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0643	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0644	Vklady ělena sítě u ústřední instituce bez povinného investo
LCR0645	Likviditní financování dostupné ělenům sítě od ústřední inst
LCR0646	Aktiva úrovně 2B u ústřední instituce považované za likvidní
LCR0647	Dodatečná aktiva úrovně 1/2A/2B zařazená z důvodu nesouladu
LCR0648	Vklady ělena sítě u ústřední instituce s povinným investován
LCR0649	Vklady ělena sítě u ústřední instituce s povinným investován
LCR0650	Vklady ělena sítě u ústřední instituce s povinným investován
LCR0651	Vklady ělena sítě u centrální instituce s povinným investová
LCR0652	Úpravy ocenění aktiv z důvodu zohlednění ěistého odtoku likv
LCR0653	Úpravy ocenění aktiv z důvodu zohlednění ěistého přítoku lik
LCR0654	Bankovní aktiva zaručená ělenskými státy podléhající ustanov
LCR0655	Agentury pro správu znehodnocených aktiv zřízené ělenskými s
LCR0656	Přechodná ustanovení pro sekuritizace zajištěné úvěry na oby
LCR0657	Aktiva úrovně 1/2A/2B vyloučená z měnových důvodů
LCR0658	Likvidní aktiva úrovně 1/2A/2B vyloučená z provozních důvodů
LCR0659	Neúročená aktiva úrovně 1 držená ÚI z náboženských důvodů
LCR0660	Neúročená aktiva úrovně 2A držená ÚI z náboženských důvodů

Datový typ údajů

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11ěis. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_AKTIVA_4	Tržní hodnota, stand.a použ. sazba, hodnota podle ě. 9 LCR D

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna ěeská
P0011	Ěasová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných měn	Položka : S_VSEMEN	Všechny měny

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_11

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_11

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_12

Název: Likvidní aktiva - významné mĚny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pĚhled likvidních aktiv, tj. aktiv, která splĚují požadavky danĚ hlavou II LCR DA, za kaĹždou mĚnu podléhající samostatnému vykazování podle ěl. 415 (2) CRR. Odpovídá sloupcĚm 010 a 040 (sloupce 020 a 030 jsou potlaĹeny a v této DO se nevykazují) tabulky L 72.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o likvidních aktivech - viz pĚíloha XXIII ěást 1 ITS.

PĚi vykazování v jednotlivých mĚnách vykazující osoba nebere v ěvahu mĚnová omezení daná ěl. 8 (6), 10 (1) (d) a 12 (1) (c) LCR DA. Vykazující osoba vřak musí zohlednit právní omezení.

PĚi vykazování hodnoty podle ěl. 9 LCR DA vykazující osoba uvádĚ tam, kde je to relevantní, hodnotu likvidních aktiv po zohlednění ěistĚho odtoku nebo pĚítoku likvidity, ke kterĚmu by dořlo v pĚĚpadĚ pĚedĚasnĚho uzavĚení zajiř•ovacího vztahu podle ěl. 8 (5) LCR DA a v souladu s odpovídajícími limity specifikovanými v kapitole 2 LCR DA.

Vykazující osoba nesmĚ vykázat řádnou položku aktiv v rámci hláření dvakrát (s výjimkou doplĚkových informací).

Veřkerá aktiva, která splĚují požadavky ěl. 7, 8 a 9 LCR DA a která má vykazující osoba v držení k datu vykazování, se vykazují na pĚĚsluřných řádcích datové oblasti, i když byly prodány nebo použity v zajiřtĚných forwardových transakcích. Toto platĚ i obrácĚní, tj. řádná likvidní aktiva nesmĚ být vykázána v této datové oblasti, z forwardových transakcí týkající se smluvnĚ odsouhlasĚných, ale nevypodádaných nákupĚ likvidních aktiv a forwardových nákupĚ likvidních aktiv.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro vřechny mĚny, ze které se vykazují data jen za významné mĚny a to v pĚĚsluřné mĚnĚ.

V popisu jednotlivých metodických objektĚ jsou použity odkazy na nĚkterĚ evropské pĚedpisy, pĚĚĚmř:

- LCR DA odkazuje na NařizenĚ Komise v pĚenesĚné pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. řĚjna 2014, kterým se doplĚuje nařizenĚ Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na ěvírovĚ instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařizenĚ Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezĚetnostních požadavcích na ěvírovĚ instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na provádĚcí nařizenĚ Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanovĚ provádĚcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucĚ pro ěĚely dohledu podle nařizenĚ Evropského parlamentu a rady (EU) ě. 575/2013, ve znĚní provádĚcího nařizenĚ komise (EU) 2016/322 ze dne 10. ěnora 2016, kterým se stanovĚ provádĚcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucĚ pro ěĚely dohledu v souvislosti s požadavkem krytĚ likvidity.

VĚĚet informaĚních prvkĚ v datové oblasti:

KĚd	Název	Datový typ ědajĚ
LCR0600	Neupravená likvidní aktiva celkem	
LCR0601	Neupravená aktiva ěrovní 1 celkem	
LCR0602	Neupravená aktiva ěrovní 1 bez krytých dluhopisĚ mimořádnĚ v	
LCR0603	Hotovost (mince a bankovky)	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_12

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0604	Ěerpatelné rezervy u centrální banky
LCR0605	Pohledávky vůči centrálním bankám
LCR0606	Pohledávky vůči ústředním vládám
LCR0607	Pohledávky vůči regionálním vládám a místním orgánům
LCR0608	Pohledávky vůči subjektům veřejného sektoru
LCR0609	Uznatelné pohledávky vůči ústřední vládě nebo centrální banc
LCR0610	Pohledávky vůči ÚI chráněným vládou ělenského státu a poskyt
LCR0611	Pohledávky vůči mezinárodním rozvojovým bankám a mezinárodní
LCR0612	Akcíe/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0613	Akcíe/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovně 1
LCR0614	Úvěrové přísliby od centrálních bank (alternativní likviditn
LCR0615	Aktiva úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvali
LCR0616	Aktiva úrovně 2A uznaná jako aktiva úrovně 1 (alternativní 1
LCR0617	Neupravené kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1
LCR0618	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality
LCR0619	Akcíe/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0620	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1 u ústřední
LCR0621	Neupravená aktiva úrovně 2 celkem
LCR0622	Neupravená aktiva úrovně 2A celkem
LCR0623	Pohledávky vůči regionálním vládám, místním orgánům a subjek
LCR0624	Pohledávky vůči centrálním bankám nebo ústředním a regionáln
LCR0625	Kryté dluhopisy vysoké kvality (stupeň úvěrové kvality 2)
LCR0626	Kryté dluhopisy vysoké kvality vydané ve třetích zemích (stu
LCR0627	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 1)
LCR0628	Akcíe/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovně 2A
LCR0629	Aktiva úrovně 2A u ústřední instituce považovaná za likvidní
LCR0630	Neupravená aktiva úrovně 2B celkem
LCR0631	Cenné papíry zajištěné úvěry na obytné nemovitostmi (stupeň
LCR0632	Cenné papíry zajištěné úvěry na financování motorových vozid
LCR0633	Kryté dluhopisy vysoké kvality s RV 35 %
LCR0634	Cenné papíry zajištěné podnikovými úvěry nebo úvěry fyzickým
LCR0635	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 2/3)
LCR0636	Neúročené podnikové dluhové CP držené ÚI z náboženských důvo
LCR0637	Akcíe tvořící součást hlavního akciového indexu
LCR0638	Neúročená aktiva držená ÚI z náboženských důvodů (stupeň úvř

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_12

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0639	Závazné likviditní přísliby centrálních bank s omezeným použ
LCR0640	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0641	Akcie/podíly v subjektech kolektivního investování s podklad
LCR0642	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0643	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0644	Vklady ělena sítě u ústřední instituce bez povinného investo
LCR0645	Likviditní financování dostupné ělenům sítě od ústřední inst
LCR0646	Aktiva úrovně 2B u ústřední instituce považované za likvidní
LCR0647	Dodatečně aktiva úrovně 1/2A/2B zařazená z důvodu nesouladu
LCR0648	Vklady ělena sítě u ústřední instituce s povinným investován
LCR0649	Vklady ělena sítě u ústřední instituce s povinným investován
LCR0650	Vklady ělena sítě u ústřední instituce s povinným investován
LCR0651	Vklady ělena sítě u centrální instituce s povinným investová
LCR0652	Úpravy ocenění aktiv z důvodu zohlednění ěistého odtoku likv
LCR0653	Úpravy ocenění aktiv z důvodu zohlednění ěistého přítoku lik
LCR0654	Bankovní aktiva zaručená ělenskými státy podléhající ustanov
LCR0655	Agentury pro správu znehodnocených aktiv zřízené ělenskými s
LCR0656	Přechodná ustanovení pro sekuritizace zajištěné úvěry na oby
LCR0657	Aktiva úrovně 1/2A/2B vyloučená z měnových důvodů
LCR0658	Likvidní aktiva úrovně 1/2A/2B vyloučená z provozních důvodů
LCR0659	Neúročená aktiva úrovně 1 držená ÚI z náboženských důvodů
LCR0660	Neúročená aktiva úrovně 2A držená ÚI z náboženských důvodů

Datový typ údajů

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11ěis. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_AKTIVA_4	Tržní hodnota, stand.a použ. sazba, hodnota podle ě. 9 LCR D

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : SHM	Vykazovaná měna
P0011	Ěasová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_12

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_12

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_13

Název: Likvidní aktiva - použitelné váhy - všechny měny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje přehled použitelných vah pro úpravu likvidních aktiv, tj. aktiv, která splňují požadavky dané hlavou II LCR DA v souhrnu za všechny měny. Odpovídá sloupci 030 tabulky L 72.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity.

"Váhou" se rozumí číslo od 0 do 1, kterým se násobí příslušná hodnota aktiv podle čl. 9 LCR DA.

Váhy se vykazují souhrnně za všechny měny.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 oabezpečnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) č. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) č. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0661	Neupravená likvidní aktiva celkem	
LCR0662	Neupravená aktiva úrovně 1 celkem	
LCR0663	Neupravená aktiva úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně v	
LCR0664	Hotovost (mince a bankovky)	
LCR0665	Ěerpatelné rezervy u centrální banky	
LCR0666	Pohledávky vůči centrálním bankám	
LCR0667	Pohledávky vůči ústředním vládám	
LCR0668	Pohledávky vůči regionálním vládám a místním orgánům	
LCR0669	Pohledávky vůči subjektům veřejného sektoru	
LCR0670	Uznatelné pohledávky vůči ústřední vládě nebo centrální banc	
LCR0671	Pohledávky vůči ÚI chráněným vládou členského státu a poskyt	
LCR0672	Pohledávky vůči mezinárodním rozvojovým bankám a mezinárodní	
LCR0673	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě	
LCR0674	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovně 1	
LCR0675	Úvěrové přísliby od centrálních bank (alternativní likviditn	
LCR0676	Aktiva úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvali	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_13

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0677	Aktiva úrovně 2A uznaná jako aktiva úrovně 1 (alternativní 1
LCR0678	Neupravené kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1
LCR0679	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality
LCR0680	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0681	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1 u ústřední
LCR0682	Neupravená aktiva úrovně 2 celkem
LCR0683	Neupravená aktiva úrovně 2A celkem
LCR0684	Pohledávky vůči regionálním vládám, místním orgánům a subjek
LCR0685	Pohledávky vůči centrálním bankám nebo ústředním a regionáln
LCR0686	Kryté dluhopisy vysoké kvality (stupeň úvěrové kvality 2)
LCR0687	Kryté dluhopisy vysoké kvality vydané ve třetích zemích (stu
LCR0688	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 1)
LCR0689	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovně 2A
LCR0690	Aktiva úrovně 2A u ústřední instituce považovaná za likvidní
LCR0691	Neupravená aktiva úrovně 2B celkem
LCR0692	Cenné papíry zajištěné úvěry na obytné nemovitostmi (stupeň
LCR0693	Cenné papíry zajištěné úvěry na financování motorových vozid
LCR0694	Kryté dluhopisy vysoké kvality s RV 35 %
LCR0695	Cenné papíry zajištěné podnikovými úvěry nebo úvěry fyzickým
LCR0696	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 2/3)
LCR0697	Neúročené podnikové dluhové CP držené ÚI z náboženských důvo
LCR0698	Akcí tvořící součást hlavního akciového indexu
LCR0699	Neúročená aktiva držaná z náboženských důvodů (stupeň úvěrov
LCR0700	Závazné likviditní přísliby centrálních bank s omezeným použ
LCR0701	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0702	Akcí/podíly v subjektech kolektivního investování s podklad
LCR0703	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0704	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0705	Vklady ělena sítí u ústřední instituce bez povinného investo
LCR0706	Likviditní financování dostupné ělenům sítí od ústřední inst
LCR0707	Aktiva úrovně 2B u ústřední instituce považované za likvidní

Datový typ údajů

Datový typ údajů v datové oblasti:

n1_2 - n3 (1 ěíselný znak + 2 desetinná místa)

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_13

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_POUSAZBA	Použitelná sazba

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných mìn	Položka : S_VSEMEN	Všechny mìn
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_13

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_14

Název: Likvidní aktiva - použitelné váhy - významné mĚny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pĚhled použitelných vah pro úpravu likvidních aktiv, tj. aktiv, která splĚují požadavky dané hlavou II LCR DA, za každou mĚnu podléhající samostatnému vykazování podle ěl. 415 (2) CRR. Odpovídá sloupci 030 tabulky L 72.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity.

"váhou" se rozumí ěíslo od 0 do 1, kterým se násobí pĚíslušná hodnota aktiv podle ěl. 9 LCR DA.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro všechny mĚny, ze které se vykazují data jen za významné mĚny.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské pĚedpisy, pĚiĚemž:

- LCR DA odkazuje na Nařizení Komise v pĚenesené pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplĚuje nařizení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvĚrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařizení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezĚetnostních požadavcích na úvĚrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařizení Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařizení Evropského parlamentu a rady (EU) ě. 575/2013, ve znění prováděcího nařizení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

VýĚet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0661	Neupravená likvidní aktiva celkem	
LCR0662	Neupravená aktiva úrovní 1 celkem	
LCR0663	Neupravená aktiva úrovní 1 bez krytých dluhopisů mimořádně v	
LCR0664	Hotovost (mince a bankovky)	
LCR0665	Ěerpatelné rezervy u centrální banky	
LCR0666	Pohledávky vůči centrálním bankám	
LCR0667	Pohledávky vůči ústředním vládám	
LCR0668	Pohledávky vůči regionálním vládám a místním orgánům	
LCR0669	Pohledávky vůči subjektům veřejného sektoru	
LCR0670	Uznatelné pohledávky vůči ústřední vládě nebo centrální banc	
LCR0671	Pohledávky vůči ÚI chráněným vládou ělenského státu a poskyt	
LCR0672	Pohledávky vůči mezinárodním rozvojovým bankám a mezinárodní	
LCR0673	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě	
LCR0674	Akcie/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovní 1	
LCR0675	ÚvĚrové pĚísliby od centrálních bank (alternativní likviditn	
LCR0676	Aktiva úrovní 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvali	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_14

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0677	Aktiva úrovně 2A uznaná jako aktiva úrovně 1 (alternativní 1
LCR0678	Neupravené kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1
LCR0679	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality
LCR0680	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0681	Kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1 u ústřední
LCR0682	Neupravená aktiva úrovně 2 celkem
LCR0683	Neupravená aktiva úrovně 2A celkem
LCR0684	Pohledávky vůči regionálním vládám, místním orgánům a subjek
LCR0685	Pohledávky vůči centrálním bankám nebo ústředním a regionáln
LCR0686	Kryté dluhopisy vysoké kvality (stupeň úvěrové kvality 2)
LCR0687	Kryté dluhopisy vysoké kvality vydané ve třetích zemích (stu
LCR0688	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 1)
LCR0689	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy úrovně 2A
LCR0690	Aktiva úrovně 2A u ústřední instituce považovaná za likvidní
LCR0691	Neupravená aktiva úrovně 2B celkem
LCR0692	Cenné papíry zajištěné úvěry na obytné nemovitostmi (stupeň
LCR0693	Cenné papíry zajištěné úvěry na financování motorových vozí
LCR0694	Kryté dluhopisy vysoké kvality s RV 35 %
LCR0695	Cenné papíry zajištěné podnikovými úvěry nebo úvěry fyzickým
LCR0696	Podnikové dluhové cenné papíry (stupeň úvěrové kvality 2/3)
LCR0697	Neúročené podnikové dluhové CP držené ÚI z náboženských dův
LCR0698	Akcí tvořící součást hlavního akciového indexu
LCR0699	Neúročená aktiva držená z náboženských důvodů (stupeň úvěrov
LCR0700	Závazné likviditní přísliby centrálních bank s omezeným použ
LCR0701	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0702	Akcí/podíly v subjektech kolektivního investování s podklad
LCR0703	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0704	Akcí/podíly v subjektech KI s podkladovými aktivy ve formě
LCR0705	Vklady ělena sítí u ústřední instituce bez povinného investo
LCR0706	Likviditní financování dostupné ělenům sítí od ústřední inst
LCR0707	Aktiva úrovně 2B u ústřední instituce považované za likvidní

Datový typ údajů

Datový typ údajů v datové oblasti:

n1_2 - n3 (1 ěíselný znak + 2 desetinná místa)

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_14

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných mìn	Nìkolik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_POUSAZBA	Použitelná sazba

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka velièiny	Položka : SHM	Vykazovaná mìn
P0011	Èasová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skuteènost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_14

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Název: Odtoky - všechny mĚny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pĚhled všech odtoků likvidity v následujících 30 dnech od data vykazování, které se používají pro výpoĚet ukazatele krytí likvidity podle LCR DA za všechny mĚny. Odpovídá sloupcům 010 až 030 a 060 (sloupce 040 a 050 jsou potlaĚeny a v této DO se nevykazují) tabulky C 73.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o odtocích - viz pĚíloha XXIII ěást 2 ITS.

V souladu s ěl. 22 (1) LCR DA odtoky likvidity zahrnují všechny položky podle ěl. 22 (2) LCR DA a jsou vypoĚítány vynásobením nevyplacených zůstatků různých kategorií nebo druhů závazků a podrozvahových závazků sazbami, pĚi kterých se oĚekává, ťe tyto závazky vyprší nebo budou vyĚerpány podle pravidel daných LCR DA. Datová oblast obsahuje i doplňující položky, které nejsou pĚímo použitelné pro výpoĚet ukazatele krytí likvidity (LCR), ale poskytují doplňující informace ke kompletnímu pohledu na likviditu a dovolují orgánu dohledu udĚlat odpovídající hodnocení souladu vykazující osoby s požadavky na likviditu. V nĚkterých pĚípadech pĚedstavují podrobnější rozklad položek, které pĚedstavují dodateĚné zdroje likvidity, ke kterým má vykazující osoba pĚístup.

LCR DA používá v řadě pĚípadů různé váhy, pomĚry a limity, kterými jsou upravovány objemy odtoků. V rámci metodiky pak slovo "vážený" (upravený), je používáno v obecném významu pro ěástky, které jsou upraveny tĚmito vahami, pomĚry a limity. Odtoky v rámci institucionálního systému ochrany (s výjimkou odtoků z nevyĚerpaných ťvírových nebo likviditních pĚíslibů poskytovaných ěleny skupiny nebo institucionálním systémem ochrany, kde orgán dohledu vydal povolení k aplikaci preferenĚní sazby odtoku z provozních depozit drťených v souvislosti s institucionálním systémem ochrany nebo v rámci kooperující sĚtí) se vykazují v odpovídajících kategoriích a zároveň jsou vykazovány i samostatně v rámci doplňujících informací.

Odtoky likvidity musí být uvedeny pouze jednou s výjimkou dodateĚných odtoků podle ěl. 30 LCR DA nebo pokud je položka souĚástí doplňujících informací. Reporting doplňujících informací neovlivňuje výpoĚet odtoků likvidity.

V datové oblasti se nevykazuje výmĚna kolaterálů, tj. kolaterál versus kolaterál transakce, které jsou vykazovány samostatně v datové oblasti LIS/LIK11_41 VýmĚna kolaterálů. V rámci datové oblasti LIS/LIK11_21 se vykazují pouze hotovost versus kolaterál transakce.

Vykazující osoby vykazují odtoky, které vycházejí z repo obchodů, reverzních repo obchodů a výmĚny kolaterálů, které budou uzavřeny v průběhu následujících 30 dnů od data vykazování a budou splatné až po 30ti denním ěasovém horizontu, pokud původní noha je důvodem odtoku (vniká-li pĚi ťvodní fázi odtok). V pĚípadi reverzních repo obchodů objem, který má být zapťjĚen protistraně musí být považován za odtok a vykázán v rámci položky "Jiné závazky" na ř. 91 - IP: LCR0798 této datové oblasti v hodnotě oĚiřtĚné o trťní hodnotu aktiva, které obdrťí jako kolaterál, a po aplikaci odpovídajících sazeb a limitů pro výpoĚet ukazatele krytí likvidity (LCR). Pokud je hodnota aktiva, které má být pťjĚeno, nižší než trťní hodnota aktiva (po aplikaci limitů pro výpoĚet LCR), které vykazující osoba obdrťí jako kolaterál, je rozdíl vykazován jako pĚítok likvidity. Pokud obdrťený kolaterál nesplňuje podmínky pro likvidní aktiva, odtok je vykazován v plně výši. V pĚípadi repo obchodů, kde trťní hodnota aktiva, která má být pťjĚeno po aplikaci odpovídajících limitů pro výpoĚet LCR (pokud je aktivum klasifikováno jako likvidní aktivum) je vĥtší než hotovost, která má být obdrťena, rozdíl se vykazuje v rámci položky "Jiné závazky" na ř. 91 - IP: LCR0798 této datové oblasti. Zde se také vykazují kolaterálové swaps v pĚípadi, ťe ěistý efekt původního swapu likvidních aktiv po zohlednění pĚíslušných limitů pro výpoĚet LCR vede k odtoku

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Charakteristika:
likvidity.

Text z ITS: Úvěrové instituce vykazují odtok vyplývající z forwardových repo operací, reverzních repo operací a kolaterálových swapů, které jsou zahájeny v 30denním horizontu a mají splatnost nad rámec 30denního horizontu, vzniká-li při úvodní fázi odtok. V případě reverzní repo operace se výše, která má být zapůjčena protistraně, považuje za odtok a vykazuje se v rámci položky 1.1.7.3 po odečtení tržní hodnoty aktiva, jež má být přijato jako kolaterál, a po uplatnění související srážky při ocenění pro účely ukazatele krytí likvidity, je-li toto aktivum považováno za likvidní. Pokud částka, která má být zapůjčena, je nižší než tržní hodnota aktiva (po srážce při ocenění pro účely ukazatele krytí likvidity), jež má být přijato jako kolaterál, vykáže se rozdíl jako přítok. Pokud kolaterál, který má být přijat, není považován za likvidní aktivum, vykazuje se odtok v plné výši. V případě repo operace, u které tržní hodnota aktiva, jež má být zapůjčeno jako kolaterál, je po uplatnění související srážky při ocenění pro účely ukazatele krytí likvidity (je-li aktivum považováno za likvidní) vyšší než peněžní částka, která má být přijata, vykáže se rozdíl jako odtok ve výše uvedeném řádku. V případě kolaterálových swapů, u kterých čistý vliv počátečního swapu likvidních aktiv (při zohlednění srážek při ocenění pro účely ukazatele krytí likvidity) vyvolá odtok, se tento odtok vykazuje ve výše uvedeném řádku.

Forwardové repo obchody, forwardové reverzní repo obchody a forwardové kolaterálové swapy, které vznikají a jsou splatné ve sledované době 30 následujících dnů, nemají vliv na výpočet ukazatele krytí likvidity (LCR), a proto nejsou vykazovány.

Pro správné určení řádku (informačního prvku), v rámci kterého má být jednotlivý odtok vykázán, je možné použít rozhodovací strom podle bodu 13 části 2 přílohy XXIII ITS. Tento rozhodovací strom se použije pro základní určení vztahu bez dopadu na doplňující položky. Rozhodovací strom specifikuje preferované zařazení příslušného odtoku v zájmu zajištění homogenního a srovnatelného reportingu. Tento rozhodovací strom však nesmí být používán izolovaně, vždy je nutné brát v úvahu i ostatní instrukce v definicích k jednotlivým informačním prvkům. Pro zjednodušení rozhodovací strom neobsahuje součtové a mezisoučtové položky.

Data se vykazují souhrnně za všechny měny v přepočtu na CZK.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 oabezpečnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) č. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) č. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ENB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0708	Odtoky celkem	
LCR0709	Odtoky z nezajištěných transakcí nebo vkladů	
LCR0710	Retailové vklady	
LCR0711	Vklady splatné v následujících 30 dnech	
LCR0712	Vklady podléhající vyšší sazbě odtoku	
LCR0713	Kategorie 1	
LCR0714	Kategorie 2	
LCR0715	Stabilní retailové vklady	
LCR0716	Stabilní retailové vklady s odchylně stanovenou sazbou odtok	
LCR0717	Vklady přijaté ve třetích zemích s vyšší sazbou odtoku	
LCR0718	Ostatní retailové vklady	
LCR0719	Provozní vklady	
LCR0720	Vklady držené v rámci poskytovaných provozních služeb	
LCR0721	Pojištěné vklady držené v rámci poskytovaných provozních slu	
LCR0722	Nepojištěné vklady držené v rámci poskytovaných provozních s	
LCR0723	Vklady držené v rámci institucionálních systémů ochrany (ISO	
LCR0724	Vklady držené v rámci ISO nebo kooperativní sítě nepovažovan	
LCR0725	Vklady držené v rámci ISO nebo kooperativní sítě sítě považo	
LCR0726	Ostatní vklady držené v rámci ostatních vztahů s nefinaněním	
LCR0727	Vklady držené z důvodu hotovostního clearingů a služeb ústře	
LCR0728	Neprovozní vklady	
LCR0729	Vklady z korespondenčního bankovníctví a poskytování makléřs	
LCR0730	Vklady finančních zákazníků	
LCR0731	Vklady ostatních zákazníků	
LCR0732	Pojištěné vklady ostatních zákazníků	
LCR0733	Nepojištěné vklady ostatních zákazníků	
LCR0734	Dodatečné odtoky	
LCR0735	Kolaterál jiný než aktiva úrovně 1 použitý pro deriváty	
LCR0736	Kolaterál pro kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovn	
LCR0737	Podstatný odtok v důsledku zhoršení vlastní úvěrové kvality	
LCR0738	Dopad nepříznivého tržního scénáře pro deriváty, finanční tr	
LCR0739	Přístup zpětného pohledu	
LCR0740	Přístup pokročilé metody pro dodatečný odtok	
LCR0741	Odtok z derivátů	
LCR0742	Krátké pozice	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0743	Krátké pozice zajištěné SFT transakcemi
LCR0744	Ostatní krátké pozice
LCR0745	Okamžitě splatný přebytečný kolaterál
LCR0746	Kolaterál splatný protistraně do 30 dnů
LCR0747	Kolaterál tvořený likvidními aktivy nahraditelnými nelikvidn
LCR0748	Ztráty vyplývající ze strukturovaného financování
LCR0749	Strukturované nástroje financování
LCR0750	Nástroje financování
LCR0751	Aktiva vypůjčená bez zajištění
LCR0752	Interní zápočty clientských pozic
LCR0753	Závazné úvěrové a likviditní přísliby
LCR0754	Úvěrové přísliby
LCR0755	Úvěrové přísliby retailovým zákazníkům
LCR0756	Úvěrové přísliby nefinančním zákazníkům jiným než retailovým
LCR0757	Úvěrové přísliby úvěrovým institucím
LCR0758	Financování podpůrných úvěrů retailovým zákazníkům
LCR0759	Financování podpůrných úvěrů nefinančním zákazníkům
LCR0760	Financování ostatních úvěrových příslibů
LCR0761	Úvěrové přísliby regulovaným finančním institucím jiným než
LCR0762	Úvěrové přísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající prefer
LCR0763	Úvěrové přísliby v rámci ISO nebo kooperativní sítě považovan
LCR0764	Úvěrové přísliby ostatním finančním zákazníkům
LCR0765	Likviditní přísliby
LCR0766	Likviditní přísliby retailovým zákazníkům
LCR0767	Likviditní přísliby nefinančním zákazníkům jiným než retailo
LCR0768	Likviditní přísliby soukromým investičním podnikům
LCR0769	Likviditní přísliby sekuritizací jednotkám pro speciální ú
LCR0770	K nákupu aktiv jiných než cenných papírů od nefinančních zák
LCR0771	Ostatní likviditní přísliby pro SPV
LCR0772	Likviditní přísliby úvěrovým institucím
LCR0773	Financování podpůrných úvěrů retailovým zákazníkům
LCR0774	Financování podpůrných úvěrů nefinančním zákazníkům
LCR0775	Financování ostatních úvěrových příslibů
LCR0776	Likviditní přísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající pre
LCR0777	Likviditní přísliby v rámci ISO nebo kooperativní sítě považ

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0778	Likviditní přísliby ostatním finančním zákazníkům
LCR0779	Ostatní produkty a služby
LCR0780	Podrozvahové a podmíněné závazky financování
LCR0781	Nevyčerpané úvěry a zálohové platby profesionálním zákazníkům
LCR0782	Sjednané, ale dosud nevyčerpané hypotéční úvěry
LCR0783	Kreditní karty
LCR0784	Poečerpání
LCR0785	Plánovaný odtok související s obnovením nebo poskytnutím nov
LCR0786	Poebytek financování nefinančním zákazníkům
LCR0787	Poebytek financování retailovým zákazníkům
LCR0788	Poebytek financování nefinančním podnikům
LCR0789	Poebytek financování ústředním vládám, mezinárodním rozvojev
LCR0790	Poebytek financování ostatním nefinančním zákazníkům
LCR0791	Ostatní plánované odtoky související s obnovenými nebo novým
LCR0792	Plánované platby z derivátů
LCR0793	Podrozvahové financování obchodu
LCR0794	Ostatní produkty a služby
LCR0795	Ostatní závazky
LCR0796	Vlastní provozní náklady
LCR0797	Dluhové cenné papíry nepovažované za retailové vklady
LCR0798	Jiné závazky
LCR0799	Odtoky ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na KT
LCR0800	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s centrální ba
LCR0801	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR0802	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR0803	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR0804	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR0805	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B
LCR0806	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR0807	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR0808	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR0809	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s ostatními pr
LCR0810	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv
LCR0811	Kolaterál úrovně 1 ve formě krytých dluhopisů mimořádně vyso
LCR0812	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0813	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR0814	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B
LCR0815	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR0816	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR0817	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR0818	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ústředním vládám
LCR0819	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ostatním protistr
LCR0820	Odtoky z výměny kolaterálů celkem
LCR0821	Retailové dluhopisy se zbytkovou splatností kratší než 30 dn
LCR0822	Retailové vklady vyjmuté z výpočtu odtoků
LCR0823	Retailové vklady nepodléhající individuálnímu posouzení
LCR0824	Odtoky likvidity započtené v rámci interních počtů
LCR0825	Provozní vklady
LCR0826	Provozní vklady úvěrových institucí
LCR0827	Provozní vklady finančních zákazníků jiných než úvěrových in
LCR0828	Provozní vklady ústředních vlád, centrálních bank, mezináro
LCR0829	Provozní vklady ostatních zákazníků
LCR0830	Neprovozní vklady
LCR0831	Neprovozní vklady úvěrových institucí
LCR0832	Neprovozní vklady finančních zákazníků jiných než úvěrových
LCR0833	Neprovozní vklady vlád, centrálních bank, mezinárodních rozv
LCR0834	Neprovozní vklady ostatních zákazníků
LCR0835	Závazky poskytnout financování nefinančním zákazníkům
LCR0836	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv
LCR0837	Kolaterál ke krytí transakcí financování cenných papírů
LCR0838	Odtoky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochran
LCR0839	Odtoky vůči finančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO
LCR0840	Odtoky vůči nefinančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO
LCR0841	Odtoky zajištěných transakcí v rámci skupiny nebo ISO
LCR0842	Odtoky úvěrových příslibů bez preferenčního zacházení v rámci
LCR0843	Odtoky likviditních příslibů bez preferenčního zacházení v r
LCR0844	Odtoky provozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO
LCR0845	Odtoky neprovozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO
LCR0846	Odtoky ze závazků ve formě dluhových CP nepovažovaných za re
LCR0847	Mínové odtoky

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0848	Odtoky likvidity způsobené problémy s transfery a nekonverti
LCR0849	Dodatečné prostředky vyžadované k doplnění rezerv u centráln

Datový typ údajů

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11 čís. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_ODTOKY_1	Hodnot y odtoku a hodnoty poskytnutého kolaterálu.

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných měn	Položka : S_VSEMEN	Všechny měny
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_21

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Název: Odtoky - významné mĚny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pĚhled vĚech odtokĚ likvidity v nĚsledujících 30 dnech od data vykazování, které se používají pro výpoĚet ukazatele krytí likvidity podle LCR DA za jednotlivé významné mĚny podle ěl. 4 (5) LCR DA. Odpovídá sloupcĚm 010 až 030 a 060 (sloupce 040 a 050 jsou potlaĚeny a v této DO se nevykazují) tabulky C 73.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o odtocích - viz pĚíloha XXIII ěást 2 ITS.

PĚi vykazování v jednotlivých mĚnách vĚdy platí nĚsledující:

- vykazují se pouze položky a toky denominované v dané mĚnĚ,
- v pĚípadi použití více mĚn mezi jednotlivými nohami (fázemi) transakce, se vyazuje pouze noha (fáze) v dané mĚnĚ,
- pokud LCR DA povoluje vyrovnání (zápoĚet), mĚže být aplikováno pouze v tocích dané mĚny,
- pokud existuje opce ve výběru mĚny daného toku z více mĚn, vykazující osoba vyhodnotí mĚnu, která bude s nejvyšší pravdĚpodobností použita a vykáže tok v této dané mĚnĚ.

V souladu s ěl. 22 (1) LCR DA odtoky likvidity zahrnují vĚechny položky podle ěl. 22 (2) LCR DA a jsou vypoĚítány jako násobek nevyplacených zĚstatků rĚzných kategorií nebo druhĚ závazků a podrozvahových závazků sazbami, pĚi kterých se oĚekává, ťe tyto závazky vyprĚší nebo budou vyĚerpány podle LCR DA. Datová oblast obsahuje i doplĚující položky, které nejsou pĚímo použitelné pro výpoĚet ukazatele krytí likvidity (LCR), ale poskytují detailní informace ke kompletnímu pohledu na likviditu a dovolují orgánu dohledu udĚlat odpovídající hodnocení souladu vykazující osoby s požadavky na likviditu. V nĚkterých pĚípadech pĚedstavují podrobnĚjší rozklad položek, které pĚedstavují dodateĚné zdroje likvidity, ke kterým má vykazující osoba pĚístup.

LCR DA používá v ěadi pĚípadĚ rĚzné váhy, pomĚry a limity, kterými jsou upravovány objemy odtokĚ. V rámci metodiky pak slovo "vážený" (upravený), je používáno v obecném významu pro ěástky, které jsou upraveny tĚmito vahami, pomĚry a limity.

Odtoky v rámci institucionálního systému ochrany (s výjimkou odtokĚ z nevyĚerpaných úvĚrových nebo likviditních pĚíslibĚ poskytovaných ěleny skupiny nebo institucionálním systémem ochrany, kde orgán dohledu vydal povolení k aplikaci preferenĚní sazby odtoku z provozních depozit drťených v souvislosti s institucionálním systémem ochrany nebo v rámci kooperující sítĚ) se vykazují v odpovídajících kategoriích a zároveň jsou vykazovány i samostatně v rámci doplĚujících informací.

Odtoky likvidity musí být uvedeny pouze jednou s výjimkou dodateĚných odtokĚ podle ěl. 30 LCR DA nebo pokud je položka souĚástí doplĚujících informací. Reporting doplĚujících informací neovlivĚuje výpoĚet odtokĚ likvidity.

V datové oblasti se nevyazuje výmĚna kolaterálĚ, tj. kolaterál versus kolaterál transakce, které jsou vykazovány samostatně v datové oblasti LIS/LIK11_41 VýmĚna kolaterálĚ. V rámci datové oblasti LIS/LIK11_21 se vykazují pouze hotovost versus kolaterál transakce.

Vyazující osoby vykazují odtoky, které vycházejí z repo obchodĚ, reverzních repo obchodĚ a výmĚny kolaterálĚ, které budou uzavĚeny v průběhu nĚsledujících 30 dnĚ od data vykazování a budou splatné až po 30ti denním ěasovém horizontu, pokud původní noha je důvodem odtoku (vniká-li pĚi úvodní fázi odtok). V pĚípadi reverzních repo obchodĚ, objem, který má být

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Charakteristika:

zapůjčen protistraně musí být považován za odtok a vykázán v rámci položky "Jiné závazky" na ř. 91- IP: LCR0798 této datové oblasti v hodnotě očištěné o tržní hodnotu aktiva, které obdrží jako kolaterál a po aplikaci odpovídajících sazeb a limitů pro výpočet ukazatele krytí likvidity (LCR). Pokud je hodnota aktiva, které má být půjčeno, nižší než tržní hodnota aktiva (po aplikaci limitů pro výpočet LCR), které vykazující osoba obdrží jako kolaterál, je rozdíl vykazován jako přítok likvidity. Pokud obdržený kolaterál nesplňuje podmínky pro likvidní aktiva, odtok je vykazován v plné výši. V případě repoobchodů, kde tržní hodnota aktiva, která má být půjčeno po aplikaci odpovídajících limitů pro výpočet LCR (pokud je aktivum klasifikováno jako likvidní aktivum) je větší než hotovost, která má být obdržena, rozdíl se vykazuje v rámci položky "Jiné závazky" na ř. 91- IP: LCR0798 této datové oblasti. Zde se také vykazují kolaterálové swapy v případě, že čistý efekt původního swapu likvidních aktiv po zohlednění příslušných limitů pro výpočet LCR vede k odtoku likvidity. Forwardové repo obchody, forwardové reverzní repo obchody a forwardové kolaterálové swapy, které vznikají a jsou splatné ve sledované době 30 následujících dnů, nemají vliv na výpočet ukazatele krytí likvidity (LCR), a proto nejsou vykazovány. Pro správné určení řádku (informačního prvku), v rámci kterého má být jednotlivý odtok vykázán, je možné použít rozhodovací strom podle bodu 13 části 2 přílohy XXIII ITS. Tento rozhodovací strom se použije pro základní určení vztahu bez dopadu na doplňující položky. Rozhodovací strom specifikuje preferované zařazení příslušného odtoku v zájmu zajištění homogenního a srovnatelného reportingu. Tento rozhodovací strom však nesmí být používán izolovaně, vždy je nutné brát v úvahu i ostatní instrukce v definicích k jednotlivým informačním prvkům. Pro zjednodušení rozhodovací strom neobsahuje součtové a mezisoučtové položky.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro všechny měny, ze které se vykazují data jen za významné měny a to v příslušné měně.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 o obezpečnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) č. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) č. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0708	Odtoky celkem	
LCR0709	Odtoky z nezajištěných transakcí nebo vkladů	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0710	Retailové vklady	
LCR0711	Vklady splatné v následujících 30 dnech	
LCR0712	Vklady podléhající vyšší sazbě odtoku	
LCR0713	Kategorie 1	
LCR0714	Kategorie 2	
LCR0715	Stabilní retailové vklady	
LCR0716	Stabilní retailové vklady s odchylně stanovenou sazbou odtok	
LCR0717	Vklady přijaté ve třetích zemích s vyšší sazbou odtoku	
LCR0718	Ostatní retailové vklady	
LCR0719	Provozní vklady	
LCR0720	Vklady držené v rámci poskytovaných provozních služeb	
LCR0721	Pojištěné vklady držené v rámci poskytovaných provozních slu	
LCR0722	Nepojištěné vklady držené v rámci poskytovaných provozních s	
LCR0723	Vklady držené v rámci institucionálních systémů ochrany (ISO	
LCR0724	Vklady držené v rámci ISO nebo kooperativní sítě nepovažovan	
LCR0725	Vklady držené v rámci ISO nebo kooperativní sítě sítě považo	
LCR0726	Ostatní vklady držené v rámci ostatních vztahů s nefinaněním	
LCR0727	Vklady držené z důvodu hotovostního clearingů a služeb ústoe	
LCR0728	Neprovozní vklady	
LCR0729	Vklady z korespondenčního bankovníctví a poskytování makléřs	
LCR0730	Vklady finančních zákazníků	
LCR0731	Vklady ostatních zákazníků	
LCR0732	Pojištěné vklady ostatních zákazníků	
LCR0733	Nepojištěné vklady ostatních zákazníků	
LCR0734	Dodatečné odtoky	
LCR0735	Kolaterál jiný než aktiva úrovně 1 použitý pro deriváty	
LCR0736	Kolaterál pro kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovn	
LCR0737	Podstatný odtok v důsledku zhoršení vlastní úvěrové kvality	
LCR0738	Dopad nepříznivého tržního scénáře pro deriváty, finanční tr	
LCR0739	Přístup zpětného pohledu	
LCR0740	Přístup pokročilé metody pro dodatečný odtok	
LCR0741	Odtok z derivátů	
LCR0742	Krátké pozice	
LCR0743	Krátké pozice zajištěné SFT transakcemi	
LCR0744	Ostatní krátké pozice	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0745	Okamžití splatný pøebyteèný kolaterál
LCR0746	Kolaterál splatný protistranì do 30 dnù
LCR0747	Kolaterál tvoøený likvidními aktivy nahraditelnými nelikvidn
LCR0748	Ztráty vyplývající ze strukturovaného financování
LCR0749	Strukturované nástroje financování
LCR0750	Nástroje financování
LCR0751	Aktiva vypùjžená bez zajištìní
LCR0752	Interní zápoèty klientských pozic
LCR0753	Závazné úvìrové a likviditní pøísliby
LCR0754	Úvìrové pøísliby
LCR0755	Úvìrové pøísliby retailovým zákazníkùm
LCR0756	Úvìrové pøísliby nefinanèním zákazníkùm jiným než retailovým
LCR0757	Úvìrové pøísliby úvìrovým institucím
LCR0758	Financování podpùrných úvìrù retailovým zákazníkùm
LCR0759	Financování podpùrných úvìrù nefinanèním zákazníkùm
LCR0760	Financování ostatních úvìrových pøíslibù
LCR0761	Úvìrové pøísliby regulovaným finanèním institucím jiným než
LCR0762	Úvìrové pøísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající prefer
LCR0763	Úvìrové pøísliby v rámci ISO nebo kooperativn sítì považovan
LCR0764	Úvìrové pøísliby ostatním finanèním zákazníkùm
LCR0765	Likviditní pøísliby
LCR0766	Likviditní pøísliby retailovým zákazníkùm
LCR0767	Likviditní pøísliby nefinanèním zákazníkùm jiným než retailo
LCR0768	Likviditní pøísliby soukromým investièním podnikùm
LCR0769	Likviditní pøísliby sekuritizaèním jednotkám pro speciální ú
LCR0770	K nákupu aktiv jiných než cenných papírù od nefinanèních zák
LCR0771	Ostatní likviditní pøísliby pro SPV
LCR0772	Likviditní pøísliby úvìrovým institucím
LCR0773	Financování podpùrných úvìrù retailovým zákazníkùm
LCR0774	Financování podpùrných úvìrù nefinanèním zákazníkùm
LCR0775	Financování ostatních úvìrových pøíslibù
LCR0776	Likviditní pøísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající pre
LCR0777	Likviditní pøísliby v rámci ISO nebo kooperativní sítì považ
LCR0778	Likviditní pøísliby ostatním finanèním zákazníkùm
LCR0779	Ostatní produkty a služby

Datový typ údajù

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ENB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0780	Podrozvahové a podmíněné závazky financování
LCR0781	Nevyčerpané úvěry a zálohové platby profesionálním zákazníkům
LCR0782	Sjednané, ale dosud nevyčerpané hypotéční úvěry
LCR0783	Kreditní karty
LCR0784	Poečerpání
LCR0785	Plánovaný odtok související s obnovením nebo poskytnutím nov
LCR0786	Přebytek financování nefinančním zákazníkům
LCR0787	Přebytek financování retailovým zákazníkům
LCR0788	Přebytek financování nefinančním podnikům
LCR0789	Přebytek financování ústředním vládám, mezinárodním rozvojev
LCR0790	Přebytek financování ostatním nefinančním zákazníkům
LCR0791	Ostatní plánované odtoky související s obnovenými nebo novým
LCR0792	Plánované platby z derivátů
LCR0793	Podrozvahové financování obchodu
LCR0794	Ostatní produkty a služby
LCR0795	Ostatní závazky
LCR0796	Vlastní provozní náklady
LCR0797	Dluhové cenné papíry nepovažované za retailové vklady
LCR0798	Jiné závazky
LCR0799	Odtoky ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na KT
LCR0800	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s centrální ba
LCR0801	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR0802	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR0803	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR0804	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR0805	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B
LCR0806	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR0807	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR0808	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR0809	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s ostatními pr
LCR0810	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv
LCR0811	Kolaterál úrovně 1 ve formě krytých dluhopisů mimořádně vyso
LCR0812	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR0813	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR0814	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0815	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR0816	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR0817	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR0818	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ústředním vládám
LCR0819	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ostatním protistr
LCR0820	Odtoky z výměny kolaterálů celkem
LCR0821	Retailové dluhopisy se zbytkovou splatností kratší než 30 dn
LCR0822	Retailové vklady vyjmuté z výpočtu odtoků
LCR0823	Retailové vklady nepodléhající individuálnímu posouzení
LCR0824	Odtoky likvidity započtené v rámci interních pohybů
LCR0825	Provozní vklady
LCR0826	Provozní vklady úvěrových institucí
LCR0827	Provozní vklady finančních zákazníků jiných než úvěrových in
LCR0828	Provozní vklady ústředních vlád, centrálních bank, mezináro
LCR0829	Provozní vklady ostatních zákazníků
LCR0830	Neprovozní vklady
LCR0831	Neprovozní vklady úvěrových institucí
LCR0832	Neprovozní vklady finančních zákazníků jiných než úvěrových
LCR0833	Neprovozní vklady vlád, centrálních bank, mezinárodních rozv
LCR0834	Neprovozní vklady ostatních zákazníků
LCR0835	Závazky poskytnout financování nefinančním zákazníkům
LCR0836	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv
LCR0837	Kolaterál ke krytí transakcí financování cenných papírů
LCR0838	Odtoky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochran
LCR0839	Odtoky vůči finančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO
LCR0840	Odtoky vůči nefinančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO
LCR0841	Odtoky zajištěných transakcí v rámci skupiny nebo ISO
LCR0842	Odtoky úvěrových příslibů bez preferenčního zacházení v rámci
LCR0843	Odtoky likviditních příslibů bez preferenčního zacházení v r
LCR0844	Odtoky provozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO
LCR0845	Odtoky neprovozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO
LCR0846	Odtoky ze závazků ve formě dluhových CP nepovažovaných za re
LCR0847	Mínové odtoky
LCR0848	Odtoky likvidity způsobené problémy s transfery a nekonverzi
LCR0849	Dodatečně prostředky vyžadované k doplnění rezerv u centráln

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
-----	-------	------------------

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11čís. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných mìn	Nìkolik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_ODTOKY_1	Hodnot y odtoku a hodnoty poskytnutého kolaterálu.

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : SHM	Vykazovaná mìn
P0011	Ěasová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_22

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_23

Název: Odtoky - použitelné váhy - všechny mĕny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pĕhled použitelných vah pro výpoĕet odtoků likvidity v souladu s hlavou II LCR DA v souhrnu za všechny mĕny. Odpovídá sloupci 050 tabulky L 73.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity.

"Váhou" se rozumí ěíslo od 0 do 1, kterým se násobí pĕíslušná hodnota pro výpoĕet odtoků.

Data se vykazují souhrnnĕ za všechny mĕny.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na nĕkteré evropské pĕedpisy, pĕiĕemž:

- LCR DA odkazuje na Nařizenĕ Komise v pĕenesenĕ pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplĕuje nařizenĕ Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvĕrovĕ instituce tĕkající se likvidity,

- CRR odkazuje na nařizenĕ Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezĕetnostních požadavcích na úvĕrovĕ instituce a investiční podniky,

ITS odkazuje na provádĕcí nařizenĕ Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanovĕ provádĕcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucĕ pro úĕĕly dohledu podle nařizenĕ Evropského parlamentu a rady (EU) ě.

575/2013, ve znĕní provádĕcího nařizenĕ Komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanovĕ provádĕcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucĕ pro úĕĕly dohledu v souvislosti s požadavkem krytĕ likvidity.

Vĕĕet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0850	Odtoky celkem	
LCR0851	Odtoky z nezajiřtĕných transakcí nebo vkladů	
LCR0852	Retailové vklady	
LCR0853	Vklady splatné v následujících 30 dnech	
LCR0854	Vklady podléhající vyšší sazbi odtoku	
LCR0855	Kategorie 1	
LCR0856	Kategorie 2	
LCR0857	Stabilní retailové vklady	
LCR0858	Stabilní retailové vklady s odchylnĕ stanovenou sazbou odtok	
LCR0859	Vklady pĕijatĕ ve tĕetĕch zemĕch s vyšší sazbou odtoku	
LCR0860	Ostatní retailové vklady	
LCR0861	Provoznĕ vklady	
LCR0862	Vklady držené v rámci poskytovaných provozních sluŕeb	
LCR0863	Pojiřtĕné vklady držené v rámci poskytovaných provozních slu	
LCR0864	Nepojiřtĕné vklady držené v rámci poskytovaných provozních s	
LCR0865	Vklady držené v rámci institucionálních systémů ochrany (ISO	
LCR0866	Vklady držené v rámci (ISO) nebo kooperativní sĕti nepovaŕov	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_23

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0867	Vklady držené v rámci (ISO) nebo kooperativní sítě sítě pova
LCR0868	Ostatní vklady držené v rámci ostatních vztahů s nefinaněním
LCR0869	Vklady držené z důvodu hotovostního clearingů a služeb ústoe
LCR0870	Neprovozní vklady
LCR0871	Vklady z korespondenčního bankovníctví a používání makléřský
LCR0872	Vklady finančních zákazníků
LCR0873	Vklady ostatních zákazníků
LCR0874	Pojištění vklady ostatních zákazníků
LCR0875	Nepojištění vklady ostatních zákazníků
LCR0876	Dodatečné odtoky
LCR0877	Kolaterál jiný než aktiva úrovně 1 použitý pro deriváty
LCR0878	Kolaterál pro kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovn
LCR0879	Podstatný odtok v důsledku zhoršení vlastní úvěrové kvality
LCR0880	Dopad nepořádného tržního scénáře pro deriváty, finanční tr
LCR0881	Přístup zpětného pohledu
LCR0882	Přístup pokročilé metody pro dodatečný odtok
LCR0883	Odtok z derivátů
LCR0884	Krátké pozice
LCR0885	Krátké pozice zajištěné SFT transakcemi
LCR0886	Ostatní krátké pozice
LCR0887	Okamžitě splatný přebytečný kolaterál
LCR0888	Kolaterál splatný protistraně do 30 dnů
LCR0889	Kolaterál tvořený likvidními aktivy nahraditelnými nelikvidn
LCR0890	Ztráty vyplývající ze strukturovaného financování
LCR0891	Strukturované nástroje financování
LCR0892	Nástroje financování
LCR0893	Aktiva vypůjčená bez zajištění
LCR0894	Interní zápočty clientských pozic
LCR0895	Závazné úvěrové a likviditní přísliby
LCR0896	Úvěrové přísliby
LCR0897	Úvěrové přísliby retailovým zákazníkům
LCR0898	Úvěrové přísliby nefinaněním zákazníkům jiným než retailovým
LCR0899	Úvěrové přísliby úvěrovým institucím
LCR0900	Financování podpůrných úvěrů retailovým zákazníkům
LCR0901	Financování podpůrných úvěrů nefinaněním zákazníkům

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_23

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0902	Financování ostatních úvěrových příslibů
LCR0903	Úvěrové přísliby regulovaným finančním institucím jiným než
LCR0904	Úvěrové přísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající prefer
LCR0905	Úvěrové přísliby v rámci ISO ochrany nebo kooperativní sítě
LCR0906	Úvěrové přísliby ostatním finančním zákazníkům
LCR0907	Likviditní přísliby
LCR0908	Likviditní přísliby retailovým zákazníkům
LCR0909	Likviditní přísliby nefinančním zákazníkům jiným než retailo
LCR0910	Likviditní přísliby soukromým investičním podnikům
LCR0911	Likviditní přísliby sekuritizací jednotkám pro speciální ú
LCR0912	K nákupu aktiv jiných než cenných papírů od nefinančních zák
LCR0913	Ostatní likviditní přísliby pro SPV
LCR0914	Likviditní přísliby úvěrovým institucím
LCR0915	Financování podpůrných úvěrů retailovým zákazníkům
LCR0916	Financování podpůrných úvěrů nefinančním zákazníkům
LCR0917	Financování ostatních úvěrových příslibů
LCR0918	Likviditní přísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající pre
LCR0919	Likviditní přísliby v rámci ISO nebo kooperativní sítě považ
LCR0920	Likviditní přísliby ostatním finančním zákazníkům
LCR0921	Ostatní produkty a služby
LCR0922	Podrozmahové a podmíněné závazky financování
LCR0923	Nevyčerpané úvěry a zálohové platby profesionálním zákazníkům
LCR0924	Sjednané, ale dosud nevyčerpané hypotéční úvěry
LCR0925	Kreditní karty
LCR0926	Přečerpání
LCR0927	Plánovaný odtok související s obnovením nebo poskytnutím nov
LCR0928	Přebytek financování nefinančním zákazníkům
LCR0929	Přebytek financování retailovým zákazníkům
LCR0930	Přebytek financování nefinančních podnikům
LCR0931	Přebytek financování ústředním vládám, mezinárodním rozvojem
LCR0932	Přebytek financování ostatním nefinančním zákazníkům
LCR0933	Ostatní plánované odtoky související s obnovenými nebo novým
LCR0934	Plánované platby z derivátů
LCR0935	Podrozmahové financování obchodu
LCR0936	Ostatní produkty a služby

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_23

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0937	Ostatní závazky	
LCR0938	Vlastní provozní náklady	
LCR0939	Dluhové cenné papíry nepovažované za retailové vklady	
LCR0940	Jiné závazky	
LCR0941	Odtoky ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na KT	
LCR0942	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s centrální ba	
LCR0943	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR0944	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR0945	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR0946	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na	
LCR0947	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B	
LCR0948	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov	
LCR0949	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR0950	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR0951	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s ostatními pr	
LCR0952	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv	
LCR0953	Kolaterál úrovně 1 ve formě krytých dluhopisů mimořádně vyso	
LCR0954	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR0955	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na	
LCR0956	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B	
LCR0957	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov	
LCR0958	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR0959	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR0960	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ústředním vládám	
LCR0961	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ostatním protistr	
LCR0962	Odtoky z výměny kolaterálů celkem	
LCR0963	Retailové dluhopisy se zbytkovou splatností kratší než 30 dn	
LCR0964	Retailové vklady vyjmuté z výpočtu odtoků	
LCR0965	Retailové vklady nepodléhající individuálnímu posouzení	
LCR0966	Odtoky likvidity započtené v rámci interních pohybů	
LCR0967	Provozní vklady	
LCR0968	Provozní vklady úvěrových institucí	
LCR0969	Provozní vklady finančních institucí jiných než úvěrových	
LCR0970	Provozní vklady ústředních vlád, centrálních bank, mezináro	
LCR0971	Provozní vklady ostatních zákazníků	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_23

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0972	Neprovozní vklady	
LCR0973	Neprovozní vklady úvěrových institucí	
LCR0974	Neprovozní vklady finančních zákazníků jiných než úvěrových	
LCR0975	Neprovozní vklady ústředních vlád, centrálních bank, mezinár	
LCR0976	Neprovozní vklady ostatních zákazníků	
LCR0977	Závazky poskytnout financování nefinančním zákazníkům	
LCR0978	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv	
LCR0979	Kolaterál ke krytí transakcí financování cenných papírů	
LCR0980	Odtoky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochran	
LCR0981	Odtoky vůči finančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0982	Odtoky vůči nefinančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0983	Odtoky zajištěných transakcí v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0984	Odtoky úvěrových příslibů bez preferenčního zacházení v rámci	
LCR0985	Odtoky likviditních příslibů bez preferenčního zacházení v r	
LCR0986	Odtoky provozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0987	Odtoky neprovozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0988	Odtoky ze závazků ve formě dluhových CP nepovažovaných za re	
LCR0989	Mínové odtoky	
LCR0990	Odtoky likvidity způsobené problémy s transfery a nekonverti	
LCR0991	Dodatečné prostředky vyžadované k doplnění rezerv u centráln	

Datový typ údajů v datové oblasti:

n1_2 - n3 (1 číselný znak + 2 desetinná místa)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_POUSAZBA	Použitelná sazba

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných mín	Položka : S_VSEMEN	Všechny miny

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_23

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_23

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_24

Název: Odtoky - použitelné váhy - významné mĚny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje přehled použitelných vah pro výpočet odtoků likvidity v souladu s hlavou II LCR DA, za každou významnou měnu podléhající samostatnému vykazování podle čl. 415 (2) CRR. Odpovídá sloupci 050 tabulky L 73.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity.

"Váhou" se rozumí číslo od 0 do 1, kterým se násobí příslušná hodnota pro výpočet odtoků.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro všechny měny, ze které se vykazují data jen za významné měny,

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 oabezpečnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) č. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) č. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0850	Odtoky celkem	
LCR0851	Odtoky z nezajištěných transakcí nebo vkladů	
LCR0852	Retailové vklady	
LCR0853	Vklady splatné v následujících 30 dnech	
LCR0854	Vklady podléhající vyšší sazbě odtoku	
LCR0855	Kategorie 1	
LCR0856	Kategorie 2	
LCR0857	Stabilní retailové vklady	
LCR0858	Stabilní retailové vklady s odchylně stanovenou sazbou odtok	
LCR0859	Vklady přijaté ve třetích zemích s vyšší sazbou odtoku	
LCR0860	Ostatní retailové vklady	
LCR0861	Provozní vklady	
LCR0862	Vklady držené v rámci poskytovaných provozních služeb	
LCR0863	Pojištěné vklady držené v rámci poskytovaných provozních slu	
LCR0864	Nepojištěné vklady držené v rámci poskytovaných provozních s	
LCR0865	Vklady držené v rámci institucionálních systémů ochrany (ISO	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_24

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0866	Vklady držené v rámci (ISO) nebo kooperativní sítě nepovažov
LCR0867	Vklady držené v rámci (ISO) nebo kooperativní sítě sítě pova
LCR0868	Ostatní vklady držené v rámci ostatních vztahů s nefinaněním
LCR0869	Vklady držené z důvodu hotovostního clearingů a služeb ústoe
LCR0870	Neprovozní vklady
LCR0871	Vklady z korespondenčního bankovníctví a používání makléřský
LCR0872	Vklady finančních zákazníků
LCR0873	Vklady ostatních zákazníků
LCR0874	Pojištěné vklady ostatních zákazníků
LCR0875	Nepojištěné vklady ostatních zákazníků
LCR0876	Dodatečné odtoky
LCR0877	Kolaterál jiný než aktiva úrovně 1 použitý pro deriváty
LCR0878	Kolaterál pro kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovn
LCR0879	Podstatný odtok v důsledku zhoršení vlastní úvěrové kvality
LCR0880	Dopad nepříznivého tržního scénáře pro deriváty, finanční tr
LCR0881	Přístup zpětného pohledu
LCR0882	Přístup pokročilé metody pro dodatečný odtok
LCR0883	Odtok z derivátů
LCR0884	Krátké pozice
LCR0885	Krátké pozice zajištěné SFT transakcemi
LCR0886	Ostatní krátké pozice
LCR0887	Okamžitě splatný přebytkový kolaterál
LCR0888	Kolaterál splatný protistraně do 30 dnů
LCR0889	Kolaterál tvořený likvidními aktivy nahraditelnými nelikvidn
LCR0890	Ztráty vyplývající ze strukturovaného financování
LCR0891	Strukturované nástroje financování
LCR0892	Nástroje financování
LCR0893	Aktiva vypůjčená bez zajištění
LCR0894	Interní zápočty clientských pozic
LCR0895	Závazné úvěrové a likviditní přísliby
LCR0896	Úvěrové přísliby
LCR0897	Úvěrové přísliby retailovým zákazníkům
LCR0898	Úvěrové přísliby nefinaněním zákazníkům jiným než retailovým
LCR0899	Úvěrové přísliby úvěrovým institucím
LCR0900	Financování podpůrných úvěrů retailovým zákazníkům

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_24

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0901	Financování podpůrných úvirů nefinaněním zákazníkům
LCR0902	Financování ostatních úvěrových příslibů
LCR0903	Úvěrové přísliby regulovaným finaněním institucím jiným než
LCR0904	Úvěrové přísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající prefer
LCR0905	Úvěrové přísliby v rámci ISO ochrany nebo kooperativní sítì
LCR0906	Úvěrové přísliby ostatním finaněním zákazníkům
LCR0907	Likviditní přísliby
LCR0908	Likviditní přísliby retailovým zákazníkům
LCR0909	Likviditní přísliby nefinaněním zákazníkům jiným než retailo
LCR0910	Likviditní přísliby soukromým investičním podnikům
LCR0911	Likviditní přísliby sekuritizací jednotkám pro speciální ú
LCR0912	K nákupu aktiv jiných než cenných papírů od nefinaněních zák
LCR0913	Ostatní likviditní přísliby pro SPV
LCR0914	Likviditní přísliby úvěrovým institucím
LCR0915	Financování podpůrných úvirů retailovým zákazníkům
LCR0916	Financování podpůrných úvirů nefinaněním zákazníkům
LCR0917	Financování ostatních úvěrových příslibů
LCR0918	Likviditní přísliby v rámci skupiny nebo ISO podléhající pre
LCR0919	Likviditní přísliby v rámci ISO nebo kooperativní sítì považ
LCR0920	Likviditní přísliby ostatním finaněním zákazníkům
LCR0921	Ostatní produkty a služby
LCR0922	Podrozkahové a podmíněné závazky financování
LCR0923	Nevěerpané úvěry a zálohové platby profesionálním zákazníkù
LCR0924	Sjednané, ale dosud nevěerpané hypotéční úvěry
LCR0925	Kreditní karty
LCR0926	Pěerpaní
LCR0927	Plánovaný odtok související s obnovením nebo poskytnutím nov
LCR0928	Pěbytek financování nefinaněním zákazníkům
LCR0929	Pěbytek financování retailovým zákazníkům
LCR0930	Pěbytek financování nefinaněním podnikům
LCR0931	Pěbytek financování ústředním vládám, mezinárodním rozvojov
LCR0932	Pěbytek financování ostatním nefinaněním zákazníkům
LCR0933	Ostatní plánované odtoky související s obnovenými nebo novým
LCR0934	Plánované platby z derivátù
LCR0935	Podrozkahové financování obchodu

Datový typ údajù

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_24

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0936	Ostatní produkty a služby
LCR0937	Ostatní závazky
LCR0938	Vlastní provozní náklady
LCR0939	Dluhové cenné papíry nepovažované za retailové vklady
LCR0940	Jiné závazky
LCR0941	Odtoky ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na KT
LCR0942	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s centrální ba
LCR0943	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR0944	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR0945	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR0946	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR0947	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B
LCR0948	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR0949	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR0950	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR0951	Zajištěné úvěrové transakce a transakce na KT s ostatními pr
LCR0952	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv
LCR0953	Kolaterál úrovně 1 ve formě krytých dluhopisů mimořádně vyso
LCR0954	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR0955	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR0956	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů úrovně 2B
LCR0957	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR0958	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR0959	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR0960	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ústředním vládám
LCR0961	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv vůči ostatním protistr
LCR0962	Odtoky z výměny kolaterálů celkem
LCR0963	Retailové dluhopisy se zbytkovou splatností kratší než 30 dn
LCR0964	Retailové vklady vyjmuté z výpočtu odtoků
LCR0965	Retailové vklady nepodléhající individuálnímu posouzení
LCR0966	Odtoky likvidity započtené v rámci interních počtů
LCR0967	Provozní vklady
LCR0968	Provozní vklady úvěrových institucí
LCR0969	Provozní vklady finančních institucí jiných než úvěrových
LCR0970	Provozní vklady ústředních vlád, centrálních bank, mezináro

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_24

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0971	Provozní vklady ostatních zákazníků	
LCR0972	Neprovozní vklady	
LCR0973	Neprovozní vklady úvěrových institucí	
LCR0974	Neprovozní vklady finančních zákazníků jiných než úvěrových	
LCR0975	Neprovozní vklady ústředních vlád, centrálních bank, mezinár	
LCR0976	Neprovozní vklady ostatních zákazníků	
LCR0977	Závazky poskytnout financování nefinančním zákazníkům	
LCR0978	Kolaterál úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně vysoké kv	
LCR0979	Kolaterál ke krytí transakcí financování cenných papírů	
LCR0980	Odtoky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochran	
LCR0981	Odtoky vůči finančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0982	Odtoky vůči nefinančním zákazníkům v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0983	Odtoky zajištěných transakcí v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0984	Odtoky úvěrových příslibů bez preferenčního zacházení v rámci	
LCR0985	Odtoky likviditních příslibů bez preferenčního zacházení v r	
LCR0986	Odtoky provozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0987	Odtoky neprovozních vkladů v rámci skupiny nebo ISO	
LCR0988	Odtoky ze závazků ve formě dluhových CP nepovažovaných za re	
LCR0989	Mínové odtoky	
LCR0990	Odtoky likvidity způsobené problémy s transfery a nekonverti	
LCR0991	Dodatečné prostředky vyžadované k doplnění rezerv u centráln	

Datový typ údajů v datové oblasti:

n1_2 - n3 (1 číselný znak + 2 desetinná místa)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných mín	Několik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_POUSAZBA	Použitelná sazba

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : SHM	Vykazovaná míra
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_24

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_24

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_31

Název: Póitoky - všechny mĚny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pøehled všech póitoků likvidity v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování, které se používají pro výpočet ukazatele krytí likvidity podle LCR DA za všechny mĚny. Odpovídá všem řádkům a sloupcům 010 až 060 a 110 až 160 (sloupce 070 až 100 jsou potlačeny a v této DO se nevykazují) tabulky C 74.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o póitocích - viz příloha XXIII část 3 ITS.

V souladu s ěl. 32 LCR DA póitoky likvidity musí:

- a) obsahovat pouze smluvně podložené póitoky z expozic, které nejsou po lhůtě splatnosti a u kterých vykazující osoba nemá žádný důvod se domnívat, že nebudou spláceny v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování,
- b) být vypočítány jako násobek hodnoty póitoku váhami podle LCR DA.

Póitoky v rámci institucionálního systému ochrany (s výjimkou póitoků z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů poskytovaných členy skupiny nebo institucionálním systémem ochrany, kde orgán dohledu vydal povolení k aplikaci preferenční sazby odtoku z provozních depozit držených v souvislosti s institucionálním systémem ochrany nebo v rámci kooperující sítě) se vykazují v odpovídajících kategoriích a zároveň jsou vykazovány i samostatně v rámci doplňujících informací.

Nezahrnují se následující póitoky:

- a) jiné póitoky uvedené v hlavě II LCR DA než splatné platby z aktiv, které nejsou zohledněny v tržní hodnotě aktiva v souladu s ěl. 32 (6) LCR DA,
- b) obdržené ve třetích zemích, kde existují omezení převodu nebo který je denominován v nekonvertibilní měně, z nichž se zahrnuje pouze ta část, která odpovídá odtoku v dané třetí zemi nebo v dané měně podle ěl. 32 (8) LCR DA,
- c) z nových závazků, které přijmou podle ěl. 32 (7) LCR DA.

Splátky cenných papírů vydaných vykazující osobou nebo spřízněným subjektem se zohledňují v čisté výši se váhou póitoku aplikovanou na základě váhy póitoku, která se používá pro podkladovou položku podle ěl. 32 LCR DA.

Veškeré informace o póitocích jsou dále členěny podle toho, do jakého limitu (75 %, 90 %) se zahrnují nebo zda jsou vyloučeny z limitů. V případě vykazování na konsolidovaném základě může vykazující osoba použít více než jednu sadu sloupců, pokud různé subjekty v rámci konsolidačního celku mají různý přístup k limitům.

Póitoky likvidity v dceřiných subjektech ve třetích zemích, kterým podle národního práva této třetí země byla přiznána nižší sazba póitoku likvidity než podle hlavy II LCR DA se do konsolidace zahrnují s těmito nižšími sazbami podle národního práva třetí země v souladu s ěl. 2 (3) (c) LCR DA.

LCR DA používá v řadě případů různé váhy, poměry a limity, kterými jsou upravovány objemy odtoků. V rámci metodiky pak slovo "vážený" (upravený), je používáno v obecném významu pro částky, které jsou upraveny těmito váhami, poměry a limity.

Pro správné určení řádku (informačního prvku), v rámci kterého má být jednotlivý póitok vykázán, je možné použít rozhodovací strom podle bodu 2.4.1 části 3 Přílohy XXIII ITS. Tento rozhodovací strom se použije pro základní určení vztahu bez dopadu na doplňující položky. Rozhodovací strom specifikuje preferované zařazení příslušného póitoku v zájmu zajištění homogenního a srovnatelného reportingu. Tento rozhodovací strom však nesmí být používán izolovaně, vždy je nutné

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_31

Charakteristika:

brát v úvahu i ostatní instrukce v definicích k jednotlivým informačním prvkům. Pro zjednodušení rozhodovací strom neobsahuje součtové a mezisoučtové položky.

Data se vykazují souhrnně za všechny měny v přepočtu na CZK.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 oabezpečnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) č. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) č. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0992	Přítoky celkem	
LCR0993	Přítoky z nezajištěných transakcí a vkladů	
LCR0994	Splátky pohledávek za nefinančními zákazníky	
LCR0995	Splátky pohledávek za nefinančními zákazníky netýkající se j	
LCR0996	Ostatní splátky pohledávek za nefinančními zákazníky	
LCR0997	Splátky pohledávek za retailovými zákazníky	
LCR0998	Splátky pohledávek za nefinančními podniky	
LCR0999	Splátky pohledávek za ústředními vládami, mezinárodními rozv	
LCR1000	Splátky pohledávek za ostatními nefinančními zákazníky	
LCR1001	Splátky pohledávek za centrálními bankami a finančními zákaz	
LCR1002	Splátky provozních vkladů finančních zákazníků	
LCR1003	Splátky provozních vkladů nefinančních zákazníků se stanoven	
LCR1004	Splátky provozních vkladů nefinančních zákazníků bez stanove	
LCR1005	Splátky neprovozních vkladů od centrálních bank a finančních	
LCR1006	Splátky neprovozních vkladů od centrálních bank	
LCR1007	Splátky neprovozních vkladů od finančních zákazníků	
LCR1008	Přítoky odpovídající odtokům souvisejícím s podpůrnými úvěro	
LCR1009	Splátky pohledávek z transakcí financování obchodu	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_31

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1010	Splátky z cenných papírů splatných do 30 dnů
LCR1011	Splátky aktiv s neurčeným datem ukončení smlouvy
LCR1012	Splátky pohledávek z pozic v kapitálových nástrojích zahrnut
LCR1013	Půjtky z nevyčerpaných úvěrových, likviditních nebo jiných
LCR1014	Půjtky z rozpuštění rezerv na ochranu obchodních aktiv záka
LCR1015	Půjtky z derivátů
LCR1016	Půjtky z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů
LCR1017	Ostatní půjčky
LCR1018	Půjtky pohledávek ze zajištěných úvěrových transakcí a tran
LCR1019	Kolaterál ve formě likvidních aktiv
LCR1020	Kolaterál úrovně I ve formě aktiv bez krytých dluhopisů mimož
LCR1021	Kolaterál úrovně I ve formě krytých dluhopisů mimožádně vyso
LCR1022	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1023	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1024	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1025	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1026	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1027	Splátky kolaterálu k zajištění krátké pozice
LCR1028	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1029	Maržové úvěry s nelikvidním kolaterálem
LCR1030	Kolaterál ve formě nelikvidního vlastního kapitálu
LCR1031	Ostatní nelikvidní kolaterál
LCR1032	Půjtky z kolaterálových swapů celkem
LCR1033	(Rozdíl mezi váženými půjtky a odtoky u transakcí v třetích
LCR1034	(Přebytek půjčky z přidružené specializované úvěrové instit
LCR1035	Vzájemně závislé půjčky
LCR1036	Mínové půjčky
LCR1037	Půjtky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochra
LCR1038	Splátky pohledávek za nefinančeními zákazníky v rámci skupiny
LCR1039	Splátky pohledávek za finančeními zákazníky v rámci skupiny n
LCR1040	Splátky pohledávek ze zajištěných transakcí v rámci skupiny
LCR1041	Splátky CP se zbytkovou splatností do 30 dnů v rámci skupiny
LCR1042	Ostatní půjčky v rámci skupiny nebo ISO
LCR1043	Půjtky z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_31

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
-----	-------	------------------

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11čís. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_PRITOKY_1	Hodnoty a sazby pro pøítoky podléhající limitům

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Ěasová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných mìn	Položka : S_VSEMEN	Všechny mìn
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_31

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_32

Název: Póitoky - významné mĚny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pøehled všech póitoků likvidity v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování, které se používají pro výpočet ukazatele krytí likvidity podle LCR DA za jednotlivé významné mĚny podle ěl. 4 (5) LCR DA všechny mĚny. Odpovídá všem řádkům a sloupcům 010 až 060 a 110 až 160 (sloupce 070 až 100 jsou potlačeny a v této DO se nevykazují) tabulky C 74.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o póitocích - viz příloha XXIII část 3 ITS.

V případě hlášení za jednotlivé významné mĚny, se z jednotlivé transakce zahrnuje vždy jen část týkající se významné mĚny. V praxi to může znamenat, že bude v daném výkaze vykázána pouze část transakce. Např. v případě mĚnového derivátu, vykazující osoba může netovat pouze póitoky a odtoky v souladu s ěl. 21 LCR DA, pokud jsou denominovány ve stejné mĚně. V souladu s ěl. 32 LCR DA póitoky likvidity musí:

- a) obsahovat pouze smluvně podložené póitoky z expozic, které nejsou po lhůtě splatnosti a u kterých vykazující osoba nemá žádný důvod se domnívat, že nebudou spláceny v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování,
- b) být vypočítány jako násobek hodnoty póitoku váhami podle LCR DA.

Póitoky v rámci institucionálního systému ochrany (s výjimkou póitoků z nevyčerpaných úvirových nebo likviditních pøislibů poskytovaných členy skupiny nebo institucionálním systémem ochrany, kde orgán dohledu vydal povolení k aplikaci preferenční sazby odtoku z provozních depozit držených v souvislosti s institucionálním systémem ochrany nebo v rámci kooperující sítě) se vykazují v odpovídajících kategoriích a zároveň jsou vykazovány i samostatně v rámci doplňujících informací.

Nezahrnují se následující póitoky:

- a) jiné póitoky uvedené v hlavě II LCR DA než splatné platby z aktiv, které nejsou zohledněny v tržní hodnotě aktiva v souladu s ěl. 32 (6) LCR DA,
- b) obdržené ve třetích zemích, kde existují omezení pøevodu nebo který je denominován v nekonvertibilní mĚně, z nichž se zahrnuje pouze ta část, která odpovídá odtoku v dané třetí zemi nebo v dané mĚně podle ěl. 32 (8) LCR DA,
- c) z nových závazků, které pøijmou podle ěl. 32 (7) LCR DA.

Splátky cenných papírů vydaných vykazující osobou nebo spřízněným subjektem se zohledňují v ěisté výši se váhou póitoku aplikovanou na základě váhou póitoku, která se používá pro podkladovou položku podle ěl. 32 LCR DA.

Veškeré informace o póitocích jsou dále ěleněny podle toho, do jakého limitu (75 %, 90 %) se zahrnují nebo zda jsou vyloučeny z limitů. V případě vykazování na konsolidovaném základě může vykazující osoba použít více než jednu sadu sloupců, pokud různé subjekty v rámci konsolidačního celku mají různý pøístup k limitům.

Póitoky likvidity v dceřiných subjektech ve třetích zemích, kterým podle národního práva této třetí země byla pøiznána nižší sazba póitoku likvidity než podle hlavy II LCR DA se do konsolidace zahrnují s těmito nižšími sazbami podle národního práva třetí země v souladu s ěl. 2 (3) (c) LCR DA.

LCR DA používá v řadě případů různé váhy, poměry a limity, kterými jsou upravovány objemy odtoků. V rámci metodiky pak slovo "vážený" (upravený), je používán v obecném významu pro částky, které jsou upraveny těmito váhami, poměry a limity.

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_32

Charakteristika:

Pro správné urĕení řádku (informaĕního prvku), v rámci kterého má být jednotlivý pŕítok vykázán, je možné použít rozhodovací strom podle bodu 2..4.1. ěásti 3 Pŕílohy XXIII ITS. Tento rozhodovací strom se použije pro základní urĕení vztahu bez dopadu na doplňující položky. Rozhodovací strom specifikuje preferované zařazení pŕíslušného pŕítoku v zájmu zajištění homogenního a srovnatelného reportingu. Tento rozhodovací strom však nesmí být používán izolovanĕ, vĕdy je nutné brát v úvahu i ostatní instrukce v definicích k jednotlivým informaĕním prvkům. Pro zjednodušení rozhodovací strom neobsahuje souĕtové a mezisouĕtové položky.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro všechny mĕny, ze které se vykazují data jen za významné mĕny a to v pŕíslušné mĕnĕ.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na nĕkteré evropské pŕedpisy, pŕiĕemĕ:

- LCR DA odkazuje na Nařizení Komise v pŕenesené pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařizení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvĕrové instituce týkající se likvidity,
 - CRR odkazuje na nařizení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezĕetnostních požadavcích na úvĕrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařizení Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro úĕely dohledu podle nařizení Evropského parlamentu a rady (EU) ě. 575/2013, ve znění prováděcího nařizení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro úĕely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Vĕĕet informaĕních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0992	Pŕítoky celkem	
LCR0993	Pŕítoky z nezajištěných transakcí a vkladů	
LCR0994	Splátky pohledávek za nefinanĕními zákazníky	
LCR0995	Splátky pohledávek za nefinanĕními zákazníky netýkající se j	
LCR0996	Ostatní splátky pohledávek za nefinanĕními zákazníky	
LCR0997	Splátky pohledávek za retailovými zákazníky	
LCR0998	Splátky pohledávek za nefinanĕními podniky	
LCR0999	Splátky pohledávek za ústředními vládami, mezinárodními rozv	
LCR1000	Splátky pohledávek za ostatními nefinanĕními zákazníky	
LCR1001	Splátky pohledávek za centrálními bankami a finanĕními zákaz	
LCR1002	Splátky provozních vkladů finanĕních zákazníků	
LCR1003	Splátky provozních vkladů nefinanĕních zákazníků se stanoven	
LCR1004	Splátky provozních vkladů nefinanĕních zákazníků bez stanove	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_32

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1005	Splátky neprovozních vkladů od centrálních bank a finančních
LCR1006	Splátky neprovozních vkladů od centrálních bank
LCR1007	Splátky neprovozních vkladů od finančních zákazníků
LCR1008	Přítoky odpovídající odtokům souvisejícím s podpůrnými úvěry
LCR1009	Splátky pohledávek z transakcí financování obchodu
LCR1010	Splátky z cenných papírů splatných do 30 dnů
LCR1011	Splátky aktiv s neurčeným datem ukončení smlouvy
LCR1012	Splátky pohledávek z pozic v kapitálových nástrojích zahrnut
LCR1013	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových, likviditních nebo jiných
LCR1014	Přítoky z rozpuštění rezerv na ochranu obchodních aktiv záka
LCR1015	Přítoky z derivátů
LCR1016	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů
LCR1017	Ostatní přítoky
LCR1018	Přítoky pohledávek ze zajištěných úvěrových transakcí a tran
LCR1019	Kolaterál ve formě likvidních aktiv
LCR1020	Kolaterál úrovně 1 ve formě aktiv bez krytých dluhopisů mimo
LCR1021	Kolaterál úrovně 1 ve formě krytých dluhopisů mimořádně vyso
LCR1022	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1023	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1024	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1025	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1026	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1027	Splátky kolaterálu k zajištění krátké pozice
LCR1028	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1029	Maržové úvěry s nelikvidním kolaterálem
LCR1030	Kolaterál ve formě nelikvidního vlastního kapitálu
LCR1031	Ostatní nelikvidní kolaterál
LCR1032	Přítoky z kolaterálových swapů celkem
LCR1033	(Rozdíl mezi váženými přítoky a odtoky u transakcí v třetích
LCR1034	(Přebytek přítoku z přidružené specializované úvěrové instit
LCR1035	Vzájemně závislé přítoky
LCR1036	Mínové přítoky
LCR1037	Přítoky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochra
LCR1038	Splátky pohledávek za nefinančními zákazníky v rámci skupiny
LCR1039	Splátky pohledávek za finančními zákazníky v rámci skupiny n

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_32

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1040	Splátky pohledávek ze zajištěných transakcí v rámci skupiny
LCR1041	Splátky CP se zbytkovou splatností do 30 dnů v rámci skupiny
LCR1042	Ostatní pøítoky v rámci skupiny nebo ISO
LCR1043	Pøítoky z nevyčerpaných úvìrových nebo likviditních pøíslibù

Datový typ údajù

Datový typ údajù v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11ěís. znakù + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrù datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných mìn	Nìkolik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_PRITOKY_1	Hodnoty a sazby pro pøítoky podléhající limitùm

Výčet konstantních parametrù datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka velièiny	Položka : SHM	Vykazovaná mìn
P0011	Ěasová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skuteènost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_32

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_33

Název: Póitoky - použitelné váhy - všechny mĩny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pøehled použitelných vah pro výpočet póitoků likvidity v souladu s hlavou II LCR DA v souhrnu za všechny mĩny. Odpovídá sloupci 080 až 100 tabulky L 74.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity.

"Váhou" se rozumí ěíslo od 0 do 1, kterým se násobí pøíslušná hodnota pro výpočet póitoků.

Data se vykazují souhrnně za všechny mĩny.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na níkteré evropské pøedpisy, pøídemž:

- LCR DA odkazuje na Naóizení Komise v pøenesené pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. óíjna 2014, kterým se doplòuje naóizení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvírové instituce týkající se likvidity,

- CRR odkazuje na naóizení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezøetnostních požadavcích na úvírové instituce a investiční podniky,

ITS odkazuje na prováděcí naóizení Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle naóizení Evropského parlamentu a rady (EU) ě.

575/2013, ve znění prováděcího naóizení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1044	Póitoky celkem	
LCR1045	Póitoky z nezajištěných transakcí a vkladů	
LCR1046	Splátky pohledávek za nefinaněními zákazníky	
LCR1047	Splátky pohledávek za nefinaněními zákazníky netýkající se j	
LCR1048	Ostatní splátky pohledávek za nefinaněními zákazníky	
LCR1049	Splátky pohledávek za retailovými zákazníky	
LCR1050	Splátky pohledávek za nefinaněními podniky	
LCR1051	Splátky pohledávek za ústředními vládami, mezinárodními rozv	
LCR1052	Splátky pohledávek za ostatními nefinaněními zákazníky	
LCR1053	Splátky pohledávek za centrálními bankami a finaněními zákaz	
LCR1054	Splátky provozních vkladů finaněních zákazníků	
LCR1055	Splátky provozních vkladů nefinaněních zákazníků se stanoven	
LCR1056	Splátky provozních vkladů nefinaněních zákazníků bez stanove	
LCR1057	Splátky neprovozních vkladů od centrálních bank a finaněních	
LCR1058	Splátky neprovozních vkladů od centrálních bank	
LCR1059	Splátky neprovozních vkladů od finaněních zákazníků	
LCR1060	Póitoky odpovídající odtokům souvisejícím s podpurnými úvíro	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_33

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1061	Splátky pohledávek z transakcí financování obchodu
LCR1062	Splátky z cenných papírů splatných do 30 dnů
LCR1063	Splátky aktiv s neurčeným datem ukončení smlouvy
LCR1064	Splátky pohledávek z pozic v kapitálových nástrojích zahrnut
LCR1065	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových, likviditních nebo jiných
LCR1066	Přítoky z rozpuštění rezerv na ochranu obchodních aktiv záka
LCR1067	Přítoky z derivátů
LCR1068	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů
LCR1069	Ostatní přítoky
LCR1070	Přítoky pohledávek ze zajištěných úvěrových transakcí a tran
LCR1071	Kolaterál ve formě likvidních aktiv
LCR1072	Kolaterál úrovně 1 ve formě aktiv bez krytých dluhopisů mimo
LCR1073	Kolaterál úrovně 1 ve formě krytých dluhopisů mimořádně vyso
LCR1074	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1075	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1076	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1077	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1078	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1079	Splátky kolaterálu k zajištění krátké pozice
LCR1080	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1081	Maržové úvěry s nelikvidním kolaterálem
LCR1082	Kolaterál ve formě nelikvidního vlastního kapitálu
LCR1083	Ostatní nelikvidní kolaterál
LCR1084	Přítoky z kolaterálových swapů celkem
LCR1085	(Rozdíl mezi váženými přítoky a odtoky u transakcí v třetích
LCR1086	(Přebytek přítoku z přidružené specializované úvěrové instit
LCR1087	Vzájemně závislé přítoky
LCR1088	Mínové přítoky
LCR1089	Přítoky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochra
LCR1090	Splátky pohledávek za nefinaněními zákazníky v rámci skupiny
LCR1091	Splátky pohledávek za finančními zákazníky v rámci skupiny n
LCR1092	Splátky pohledávek ze zajištěných transakcí v rámci skupiny
LCR1093	Splátky CP se zbytkovou splatností do 30 dnů v rámci skupiny
LCR1094	Ostatní přítoky v rámci skupiny nebo ISO
LCR1095	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_33

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
-----	-------	------------------

Datový typ údajů v datové oblasti:

n1_2 - n3 (1 číselný znak + 2 desetinná místa)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_PSAZBA_PRITOKY	Použitelná sazba prítoky

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných mìn	Položka : S_VSEMEN	Všechny mìn
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_33

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_34

Název: Pøítoky - použitelné váhy - významné mîny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje pøehled použitelných vah pro výpoèet pøítokù likvidity v souladu s hlavou II LCR DA, za každou významnou mînu podléhající samostatnému vykazování podle ěl. 415 (2) CRR. Odpovídá sloupci 080 až 100 tabulky L 74.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity.

"Váhou" se rozumí ěíslo od 0 do 1, kterým se násobí pøíslušná hodnota pro výpoèet pøítokù.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro všechny mîny, ze které se vykazují data jen za významné mîny,

V popisu jednotlivých metodických objektù jsou použity odkazy na níkteré evropské pøedpisy, pøíèemž:

- LCR DA odkazuje na Naøízení Komise v pøenesené pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. øíjna 2014, kterým se doplòuje naøízení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvìrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na naøízení Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezøetnostních požadavcích na úvìrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí naøízení Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro úèely dohledu podle naøízení Evropského parlamentu a rady (EU) ě. 575/2013, ve znění prováděcího naøízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro úèely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výèet informaèních prvkù v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajù
LCR1044	Pøítoky celkem	
LCR1045	Pøítoky z nezajištìných transakcí a vkladù	
LCR1046	Splátky pohledávek za nefinanèními zákazníky	
LCR1047	Splátky pohledávek za nefinanèními zákazníky netýkající se j	
LCR1048	Ostatní splátky pohledávek za nefinanèními zákazníky	
LCR1049	Splátky pohledávek za retailovými zákazníky	
LCR1050	Splátky pohledávek za nefinanèními podniky	
LCR1051	Splátky pohledávek za ústøedními vládami, mezinárodními rozv	
LCR1052	Splátky pohledávek za ostatními nefinanèními zákazníky	
LCR1053	Splátky pohledávek za centrálními bankami a finanèními zákaz	
LCR1054	Splátky provozních vkladù finanèních zákazníků	
LCR1055	Splátky provozních vkladù nefinanèních zákazníků se stanoven	
LCR1056	Splátky provozních vkladù nefinanèních zákazníků bez stanove	
LCR1057	Splátky neprovozních vkladù od centrálních bank a finanèních	
LCR1058	Splátky neprovozních vkladù od centrálních bank	
LCR1059	Splátky neprovozních vkladù od finanèních zákazníků	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_34

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1060	Přítoky odpovídající odtokům souvisejícím s podpůrnými úvěry
LCR1061	Splátky pohledávek z transakcí financování obchodu
LCR1062	Splátky z cenných papírů splatných do 30 dnů
LCR1063	Splátky aktiv s neurčeným datem ukončení smlouvy
LCR1064	Splátky pohledávek z pozic v kapitálových nástrojích zahrnut
LCR1065	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových, likviditních nebo jiných
LCR1066	Přítoky z rozpuštění rezerv na ochranu obchodních aktiv záka
LCR1067	Přítoky z derivátů
LCR1068	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů
LCR1069	Ostatní přítoky
LCR1070	Přítoky pohledávek ze zajištěných úvěrových transakcí a tran
LCR1071	Kolaterál ve formě likvidních aktiv
LCR1072	Kolaterál úrovně 1 ve formě aktiv bez krytých dluhopisů mimo
LCR1073	Kolaterál úrovně 1 ve formě krytých dluhopisů mimořádně vyso
LCR1074	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1075	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1076	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1077	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1078	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1079	Splátky kolaterálu k zajištění krátké pozice
LCR1080	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1081	Maržové úvěry s nelikvidním kolaterálem
LCR1082	Kolaterál ve formě nelikvidního vlastního kapitálu
LCR1083	Ostatní nelikvidní kolaterál
LCR1084	Přítoky z kolaterálových swapů celkem
LCR1085	(Rozdíl mezi váženými přítoky a odtoky u transakcí v třetích
LCR1086	(Přebytek přítoku z přidružené specializované úvěrové instit
LCR1087	Vzájemně závislé přítoky
LCR1088	Minové přítoky
LCR1089	Přítoky v rámci skupiny nebo institucionálního systému ochra
LCR1090	Splátky pohledávek za nefinančními zákazníky v rámci skupiny
LCR1091	Splátky pohledávek za finančními zákazníky v rámci skupiny n
LCR1092	Splátky pohledávek ze zajištěných transakcí v rámci skupiny
LCR1093	Splátky CP se zbytkovou splatností do 30 dnů v rámci skupiny
LCR1094	Ostatní přítoky v rámci skupiny nebo ISO

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_34

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1095	Přítoky z nevyčerpaných úvěrových nebo likviditních příslibů

Datový typ údajů

Datový typ údajů v datové oblasti:

n1_2 - n3 (1 číselný znak + 2 desetinná místa)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných mìn	Nìkolik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_PSAZBA_PRITOKY	Použitelná sazba přítoky

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : SHM	Vykazovaná mìn
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_34

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_41

Název: Výmĭna kolaterálů - všechny mĭny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje všechny transakce splatné v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování, ve kterých jsou nehotovostní aktiva vymĭnĭna za jiná nehotovostní aktiva podle LCR DA za všechny mĭny a odpovĭdĭ tabulce C 75.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o výmĭni kolaterálů - viz pŕíloha XXIII ěást 4 ITS.

Každá výmĭna kolaterálů je posuzována samostatně a každý pohyb je vykazován jako odtok nebo pŕítok v odpovĭdajícím řádku datové oblasti. Pokud jedna transakce obsahuje více typů kolaterálu, který je vymĭřován, potom taková transakce musí být rozdělena do ěástí až na úroveň požadovaného detailu v rámci typů kolaterálu.

Výmĭna kolaterálů splatných v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování vede k odtoku, pokud likviditní hodnota vypŕjĕených aktiv je vyšší než likviditní hodnota aktiv pŕjĕených, pokud není protistranou centrální banka, kdy je aplikován nulový odtok.

Výmĭna kolaterálů splatných v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování vede k pŕítoku, pokud likviditní hodnota pŕjĕených aktiv je vyšší než likviditní hodnota aktiv vypŕjĕených, pokud obdržený kolaterál není použit ke krytí krátkých pozic, které je možné prodloužit na dobu delší než 10 dnů, kdy je aplikován nulový pŕítok.

Likviditní hodnota je v pŕípadi likvidních aktiv hodnota podle ěl. 9 LCR DA, v pŕípadi nelikvidních aktiv "0".

Kolaterizované deriváty se vykazují samostatně.

Vykazují se pouze aktiva úrovnĭ 1, 2A a 2B, která jsou klasifikována jako likvidní aktiva v souladu s hlavou II LCR DA. Pro pŕjĕený kolaterál to znamená aktiva, která jsou vzhledem ke své splatnosti považována za likvidní podle hlavy II LCR DA a splňují obecné a provozní požadavky podle ěl. (7) a (8) LCR DA.

V pŕípadi, že kolaterál splňuje kritéria pro aktiva úrovnĭ 1, 2A a 2B podle ěl. 10 až 19 LCR DA, ale není považován za likvidní aktivum podle hlavy II LCR DA, vyazuje se jako nelikvidní aktivum. Podobně, pokud vykazující osoba mŕže urĕit pouze ěást akcií nebo pohledávek vůči centrálním vládám nebo bankám v cizí mĭni, nebo pohledávky vůči centrálním vládám nebo bankám v domácí mĭni jako mimořádně vysoce likvidní aktiva, vyazuje se pouze tato ěást (ěl. 12 (1) (c) (i) až (iii) a ěl. (10) (1) (d) LCR DA. Tam, kde je pŕíslušné aktivum použito jako kolaterál, ale v hodnotĭ, která pŕevyšuje ěást, která je považována za likvidní, je tento pŕebytek vykazován jako nelikvidní aktivum.

Výmĭny kolaterálů, ve kterých jsou zapojena aktiva úrovnĭ 2A se vykazují v relevantních řádcích i v pŕípadi, že je použit alternativní likviditní pŕístup, tj. aktiva úrovnĭ 2A se nepŕesouvají do aktiv úrovnĭ 1.

Data se vykazují souhrnně za všechny mĭny v pŕepoĕtu na CZK.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské pŕedpisy, pŕiĕemž:

- LCR DA odkazuje na Nařizenĭ Komise v pŕenesenĕ pravomoci (EU) ě. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařizenĭ Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvĭrovĕ instituce týkající se likvidity,
 - CRR odkazuje na nařizenĭ Evropského parlamentu a Rady (EU) ě. 575/2013 ze dne 26. ěervna 2013 o obezĕetnostních požadavcích na úvĭrovĕ instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na provádĕcí nařizenĭ Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanovĭ provádĕcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucĭ pro účely dohledu podle nařizenĭ Evropského parlamentu a rady (EU) ě.

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_41

Charakteristika:

575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1096	Kolaterálové swapy a deriváty zajištěné kolaterálem celkem	
LCR1097	Poskytnutá aktiva úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně v	
LCR1098	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR1099	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR1100	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR1101	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na	
LCR1102	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit	
LCR1103	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov	
LCR1104	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR1105	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR1106	Poskytnuté kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1	
LCR1107	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR1108	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR1109	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR1110	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na	
LCR1111	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit	
LCR1112	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov	
LCR1113	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR1114	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR1115	Poskytnutá aktiva úrovně 2A krytá přijatým kolaterálem	
LCR1116	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR1117	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR1118	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR1119	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na	
LCR1120	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit	
LCR1121	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov	
LCR1122	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR1123	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR1124	Poskytnuté CP zajištěné aktivity úrovně 2B (úvěry na obytné ne	
LCR1125	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_41

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1126	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality
LCR1127	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1128	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1129	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvality
LCR1130	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1131	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1132	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1133	Poskytnuté kryté dluhopisy vysoké kvality úrovně 2B kryté pø
LCR1134	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1135	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality
LCR1136	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1137	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1138	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvality
LCR1139	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (korporát
LCR1140	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1141	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1142	Poskytnuté CP úrovně 2B zajištěné podnikovými úvěry nebo úvì
LCR1143	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1144	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality
LCR1145	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1146	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1147	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvality
LCR1148	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1149	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1150	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1151	Poskytnutá ostatní aktiva úrovně 2B krytá přijatým kolaterálem
LCR1152	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1153	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality
LCR1154	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1155	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1156	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvality
LCR1157	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1158	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1159	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1160	Poskytnutá nelikvidní aktiva krytá přijatým kolaterálem

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_41

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1161	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1162	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR1163	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1164	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na
LCR1165	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1166	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov
LCR1167	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1168	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1169	Kolaterálové swapy celkem s použitím přijatého kolaterálu k
LCR1170	Kolaterálové swapy s členy skupiny celkem
LCR1171	Kolaterálové swapy s centrálními bankami celkem

Datový typ údajů

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11čís. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_KOLATERAL	Hodnoty pro výměnu kolaterálů

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných měn	Položka : S_VSEMEN	Všechny měny
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_41

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_42

Název: VýmĚna kolaterálů - významné mĚny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje všechny transakce splatné v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování, ve kterých jsou nehotovostní aktiva vymĚna za jiná nehotovostní aktiva podle LCR DA za jednotlivé významné mĚny a odpovídá tabulce C 75.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o výmĚnĚ kolaterálů - viz příloha XXIII část 4 ITS.

Každá výmĚna kolaterálů je posuzována samostatně a každý pohyb je vykazován jako odtok nebo pĚítok v odpovídajícím řádku datové oblasti. Pokud jedna transakce obsahuje více typů kolaterálu, který je vymĚňován, potom taková transakce musí být rozdělena do částí až na úroveň požadovaného detailu v rámci typů kolaterálu. VýmĚna kolaterálů splatných v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování vede k odtoku, pokud likviditní hodnota vypůjčených aktiv je vyšší než likviditní hodnota aktiv půjčených, pokud není protistranou centrální banka, kdy je aplikován nulový odtok.

VýmĚna kolaterálů splatných v následujících 30 kalendářních dnech od data vykazování vede k pĚítoku, pokud likviditní hodnota půjčených aktiv je vyšší než likviditní hodnota aktiv vypůjčených, pokud obdržený kolaterál není použit ke krytí krátkých pozic, které je možné prodloužit na dobu delší než 10 dnů, kdy je aplikován nulový pĚítok.

Likviditní hodnota je v případě likvidních aktiv hodnota podle čl. 9 LCR DA, v případě nelikvidních aktiv "0".

Kolaterizované deriváty se vykazují samostatně.

Vykazují se pouze aktiva úrovnĚ 1, 2A a 2B, která jsou klasifikována jako likvidní aktiva v souladu s hlavou II LCR DA. Pro půjčený kolaterál to znamená aktiva, která jsou vzhledem ke své splatnosti považována za likvidní podle hlavy II LCR DA a splňují obecné a provozní požadavky podle čl. (7) a (8) LCR DA.

V případě, že kolaterál splňuje kritéria pro aktiva úrovnĚ 1, 2A a 2B podle čl. 10 až 19 LCR DA, ale není považován za likvidní aktivum podle hlavy II LCR DA, vyazuje se jako nelikvidní aktivum. Podobně, pokud vykazující osoba může urĚit pouze část akcií nebo pohledávek vůči centrálním vládám nebo bankám v cizí mĚnĚ, nebo pohledávky vůči centrálním vládám nebo bankám v domácí mĚnĚ jako mimořádně vysoce likvidní aktiva, vyazuje se pouze tato část (čl. 12 (1) (c) (i) až (iii) a čl. (10) (1) (d) LCR DA. Tam, kde je příslušné aktivum použito jako kolaterál, ale v hodnotĚ, která pĚevyšuje část, která je považována za likvidní, je tento pĚebytek vykazován jako nelikvidní aktivum.

VýmĚny kolaterálů, ve kterých jsou zapojena aktiva úrovnĚ 2A se vykazují v relevantních řádcích i v případě, že je použit alternativní likviditní pĚístup, tj. aktiva úrovnĚ 2A se nepřesouvají do aktiv úrovnĚ 1.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro všechny mĚny, ze kterých se vykazují data jen za významné mĚny a to v příslušné mĚnĚ.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 oabezpečnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_42

Charakteristika:

ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) ě. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) ě. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1096	Kolaterálové swapy a deriváty zajištěné kolaterálem celkem	
LCR1097	Poskytnutá aktiva úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně v	
LCR1098	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR1099	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR1100	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR1101	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (úvěry na	
LCR1102	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit	
LCR1103	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (podnikov	
LCR1104	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR1105	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR1106	Poskytnuté kryté dluhopisy mimořádně vysoké kvality úrovně 1	
LCR1107	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR1108	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR1109	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR1110	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (úvěry na	
LCR1111	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit	
LCR1112	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (podnikov	
LCR1113	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR1114	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR1115	Poskytnutá aktiva úrovně 2A krytá přijatým kolaterálem	
LCR1116	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR1117	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR1118	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR1119	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (úvěry na	
LCR1120	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit	
LCR1121	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (podnikov	
LCR1122	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR1123	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_42

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR1124	Poskytnuté CP zajištěné aktivity úrovně 2B (úvěry na obytné ne
LCR1125	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1126	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR1127	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1128	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (úvěry na
LCR1129	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1130	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (podnikov
LCR1131	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1132	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1133	Poskytnuté kryté dluhopisy vysoké kvality úrovně 2B kryté pø
LCR1134	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1135	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR1136	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1137	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (úvěry na
LCR1138	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1139	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (korporát
LCR1140	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1141	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1142	Poskytnuté CP úrovně 2B zajištěné podnikovými úvěry nebo úvì
LCR1143	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1144	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR1145	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1146	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (úvěry na
LCR1147	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1148	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (podnikov
LCR1149	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B
LCR1150	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv
LCR1151	Poskytnutá ostatní aktiva úrovně 2B krytá přijatým kolaterá
LCR1152	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo
LCR1153	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit
LCR1154	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A
LCR1155	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (úvěry na
LCR1156	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit
LCR1157	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivity úrovně 2B (podnikov
LCR1158	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_42

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1159	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR1160	Poskytnutá nelikvidní aktiva krytá přijatým kolaterálem	
LCR1161	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimo	
LCR1162	Kolaterál ve formě krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	
LCR1163	Kolaterál ve formě aktiv úrovně 2A	
LCR1164	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (úvěry na	
LCR1165	Kolaterál úrovně 2B ve formě krytých dluhopisů vysoké kvalit	
LCR1166	Kolaterál ve formě CP zajištěných aktivy úrovně 2B (podnikov	
LCR1167	Kolaterál ve formě ostatních aktiv úrovně 2B	
LCR1168	Kolaterál ve formě nelikvidních aktiv	
LCR1169	Kolaterálové swapy celkem s použitím přijatého kolaterálu k	
LCR1170	Kolaterálové swapy s členy skupiny celkem	
LCR1171	Kolaterálové swapy s centrálními bankami celkem	

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11_3T - n14 (11čís. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných mìn	Nìkolik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_KOLATERAL	Hodnoty pro výmìnu kolaterálù

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : SHM	Vykazovaná mìn
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_42

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_51

Název: Výpočet ukazatele krytí likvidity - všechny mĚny v CZK

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje údaje pro výpočet ukazatele krytí likvidity podle LCR DA za všechny mĚny a odpovídá tabulce C 76.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity.

Detailní popis pro vykazování informací o výpočtu ukazatele krytí likvidity - viz příloha XXIII část 5 ITS.

Data se vykazují souhrnně za všechny mĚny v počtu na CZK a ukazatel krytí likvidity v %.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 o obězpetnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) č. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) č. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1172	Rezerva v oblasti likvidity	n11_3T
LCR1173	Ěistý odtok likvidity	n11_3T
LCR1174	Ukazatel krytí likvidity v %	p6_3
LCR1175	Rezerva v oblasti likvidity úrovně 1 bez krytých dluhopisů m	n11_3T
LCR1176	Odtoky kolaterálu úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně v	n11_3T
LCR1177	Přítoky kolaterálu úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně	n11_3T
LCR1178	Zajištěné odtoky hotovosti v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1179	Zajištěné přítoky hotovosti v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1180	Upravená hodnota aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořá	n11_3T
LCR1181	Neupravená hodnota krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	n11_3T
LCR1182	Odtoky kolaterálu úrovně 1 tvořeného krytými dluhopisy mimoř	n11_3T
LCR1183	Přítoky kolaterálu úrovně 1 tvořeného krytými dluhopisy mimo	n11_3T
LCR1184	Upravená hodnota krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality	n11_3T
LCR1185	Upravená hodnota krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality	n11_3T
LCR1186	Přebytek likvidních krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvali	n11_3T
LCR1187	Neupravená hodnota aktiv úrovně 2A podle čl. 9 LCR DA	n11_3T
LCR1188	Odtoky kolaterálu úrovně 2A v následujících 30 dnech	n11_3T

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_51

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1189	Přítoky kolaterálu úrovně 2A v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1190	Upravená hodnota aktiv úrovně 2A před použitím limitu	n11_3T
LCR1191	Upravená hodnota aktiv úrovně 2A po použití limitu	n11_3T
LCR1192	Přebytek likvidních aktiv úrovně 2A	n11_3T
LCR1193	Neupravená hodnota aktiv úrovně 2B podle čl. 9 LCR DA	n11_3T
LCR1194	Odtoky kolaterálu úrovně 2B v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1195	Přítoky kolaterálu úrovně 2B v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1196	Upravená hodnota aktiv úrovně 2B před použitím limitu	n11_3T
LCR1197	Upravená hodnota aktiv úrovně 2B po použití limitu	n11_3T
LCR1198	Přebytek likvidních aktiv úrovně 2B	n11_3T
LCR1199	Přebytek likvidních aktiv	n11_3T
LCR1200	Rezerva v oblasti likvidity	n11_3T
LCR1201	Odtoky celkem	n11_3T
LCR1202	Plně vyjmuté přítoky	n11_3T
LCR1203	Přítoky podléhající limitu 90 %	n11_3T
LCR1204	Přítoky podléhající limitu 75 %	n11_3T
LCR1205	Snížení pro plně vyjmuté přítoky	n11_3T
LCR1206	Snížení pro přítoky podléhající limitu 90 %	n11_3T
LCR1207	Snížení pro přítoky podléhající limitu 75 %	n11_3T
LCR1208	Čistý odtok likvidity	n11_3T
LCR1209	Likviditní požadavky podle Přílohy 2 stanovené v článku 105 C	n11_3T

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_HODNOTA_1	Hodnota nebo %

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_51

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných mìn	Položka : S_VSEMEN	Všechny mìn
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_51

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od:

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_52

Název: Výpočet ukazatele krytí likvidity - významné mĚny

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje údaje pro výpočet ukazatele krytí likvidity podle LCR DA za jednotlivé významné mĚny a odpovídá tabulce C 76.00 jednotného rámce pro reporting v oblasti likvidity. Detailní popis pro vykazování informací o výpočtu ukazatele krytí likvidity - viz příloha XXIII část 5 ITS.

V této DO je použita karta (Z_MENLIK3) pro všechny mĚny, ze které se vykazují data jen za významné mĚny a to v příslušné mĚně a ukazatel krytí likvidity v %.

V popisu jednotlivých metodických objektů jsou použity odkazy na některé evropské předpisy, přičemž:

- LCR DA odkazuje na Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) č. 61/2015 ze dne 10. října 2014, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se likvidity,
- CRR odkazuje na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 oabezpečnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na prováděcí nařízení Komise (EU) č. 680/2014 ze dne 16. dubna 2014, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a rady (EU) č. 575/2013, ve znění prováděcího nařízení komise (EU) 2016/322 ze dne 10. února 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o podávání zpráv institucí pro účely dohledu v souvislosti s požadavkem krytí likvidity.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1172	Rezerva v oblasti likvidity	n11_3T
LCR1173	Ěistý odtok likvidity	n11_3T
LCR1174	Ukazatel krytí likvidity v %	p6_3
LCR1175	Rezerva v oblasti likvidity úrovně 1 bez krytých dluhopisů m	n11_3T
LCR1176	Odtoky kolaterálu úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně v	n11_3T
LCR1177	Přítoky kolaterálu úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořádně	n11_3T
LCR1178	Zajištěné odtoky hotovosti v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1179	Zajištěné přítoky hotovosti v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1180	Upravená hodnota aktiv úrovně 1 bez krytých dluhopisů mimořá	n11_3T
LCR1181	Neupravená hodnota krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvalit	n11_3T
LCR1182	Odtoky kolaterálu úrovně 1 tvořeného krytými dluhopisy mimoř	n11_3T
LCR1183	Přítoky kolaterálu úrovně 1 tvořeného krytými dluhopisy mimo	n11_3T
LCR1184	Upravená hodnota krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality	n11_3T
LCR1185	Upravená hodnota krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvality	n11_3T
LCR1186	Přebytek likvidních krytých dluhopisů mimořádně vysoké kvali	n11_3T
LCR1187	Neupravená hodnota aktiv úrovně 2A podle čl. 9 LCR DA	n11_3T

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_52

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR1188	Odtoky kolaterálu úrovně 2A v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1189	Přítoky kolaterálu úrovně 2A v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1190	Upravená hodnota aktiv úrovně 2A před použitím limitu	n11_3T
LCR1191	Upravená hodnota aktiv úrovně 2A po použití limitu	n11_3T
LCR1192	Přebytek likvidních aktiv úrovně 2A	n11_3T
LCR1193	Neupravená hodnota aktiv úrovně 2B podle čl. 9 LCR DA	n11_3T
LCR1194	Odtoky kolaterálu úrovně 2B v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1195	Přítoky kolaterálu úrovně 2B v následujících 30 dnech	n11_3T
LCR1196	Upravená hodnota aktiv úrovně 2B před použitím limitu	n11_3T
LCR1197	Upravená hodnota aktiv úrovně 2B po použití limitu	n11_3T
LCR1198	Přebytek likvidních aktiv úrovně 2B	n11_3T
LCR1199	Přebytek likvidních aktiv	n11_3T
LCR1200	Rezerva v oblasti likvidity	n11_3T
LCR1201	Odtoky celkem	n11_3T
LCR1202	Plně vyjmuté přítoky	n11_3T
LCR1203	Přítoky podléhající limitu 90 %	n11_3T
LCR1204	Přítoky podléhající limitu 75 %	n11_3T
LCR1205	Snížení pro plně vyjmuté přítoky	n11_3T
LCR1206	Snížení pro přítoky podléhající limitu 90 %	n11_3T
LCR1207	Snížení pro přítoky podléhající limitu 75 %	n11_3T
LCR1208	Čistý odtok likvidity	n11_3T
LCR1209	Likviditní požadavky podle Přílohy 2 stanovené v článku 105 C	n11_3T

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK3	Zásobník pro FPS/FPK10_41a LISIFE/LIKIFE11
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_HODNOTA_1	Hodnota nebo %

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0009	Jednotka veličiny	Položka : SHM	Vykazovaná měna
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_52

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Datová oblast: LIS11_52

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Zdroj:

Stav:Projektovaný

Garant: /

Platnost od: