

Kód: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Název: Likvidita podle DA

Charakteristika:

Hlášení ke sledování likvidních aktiv a výpočtu ukazatele krytí likvidity na individuálním základě v souladu s přímo použitelnými předpisy Evropské unie upravujícími obezřetnostní požadavky, tj. zejména nařízení komise v přenesené pravomoci (EU) 61/2015, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013, pokud jde o požadavek na úvěrové instituce týkající se krytí likvidity (LCR DA). Hlášení je sestaveno na základě jednotného reportovacího rámce (tabulky C 72.00 až C 76.00), který je součástí přímo účinných implementačních technických standardů (ITS) pro reporting v oblasti dohledu a to podle přílohy XXII Šablony pro likviditu a přílohy XXIII Podávání zpráv o likviditě

Hlášení se skládá z 5 částí:

1. Likvidní aktiva, která obsahují přehled likvidních aktiv, tj. aktiv splňujících požadavky dané hlavou II LCR DA,
2. Odtoky, které zahrnují informace o všech odtocích likvidity, ke kterým dojde v následujících 30 dnech od data sestavení hlášení,
3. Póitoky, které zahrnují informace o všech póitocích likvidity, ke kterým dojde v následujících 30 dnech od data sestavení hlášení,
4. Výmna kolaterálů, která obsahuje informace o všech transakcích, které budou splatné v následujících 30 dnech od data sestavení hlášení, ve kterých nehotovostní aktiva jsou vyměněna za jiná nehotovostní aktiva,
5. Výpočet ukazatele krytí likvidity, který shrnuje informace potřebné pro výpočet ukazatele krytí likvidity na základě LCR DA.

Hlášení se sestavuje za všechny měny přepočítané na CZK a dále za jednotlivé významné měny, které splňují podmínky čl. 415 (2) CRR; tato data jsou vykazována v konkrétní měně (tj. bez přepočtu na Kč). V případě vykazování v jednotlivých měnách se neberou v úvahu měnová omezení uvedená v čl. 8 (6), 10 (1) (d) a 12 (1) (c) LCR DA, ale vykazující osoba musí brát v úvahu všechna právní omezení. V hlášení je slovo "vážený" (upravený) použito v obecném smyslu, tj. indikuje skutečnost, že uvedená částka je výsledkem promítnutí různých vah, limitů apod. podle LCR DA.

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

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 obezřetnostních 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.

Hlášení vyplňují banky, pobočky zahraničních bank ze třetích zemí a družstevní záložny. Obchodníci s cennými papíry toto hlášení nevyplňují. V případě likviditní podskupiny se postupuje individuálně podle rozhodnutí ĚNB. V těchto případech vykazující osoba vykazuje toto hlášení na individuálním základě i za další členy likviditní podskupiny (tj. hlášení je konsolidované jen za členy likviditní podskupiny a vylučují se jen jejich vzájemné pohledávky a závazky).

Kód: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Název: Likvidita podle DA

Ěásti datového souboru:

Ěást: 1 - Aktiva

Pøioazené datové oblasti:

Pøoadí	Kód	Název
1	LIS11_11	Likvidní aktiva - všechny mĚny v CZK
2	LIS11_12	Likvidní aktiva - významné mĚny
3	LIS11_13	Likvidní aktiva - použitelné váhy - všechny mĚny v CZK
4	LIS11_14	Likvidní aktiva - použitelné váhy - významné mĚny

Ěást: 2 - Odtoky

Pøioazené datové oblasti:

Pøoadí	Kód	Název
1	LIS11_21	Odtoky - všechny mĚny v CZK
2	LIS11_22	Odtoky - významné mĚny
3	LIS11_23	Odtoky - použitelné váhy - všechny mĚny v CZK
4	LIS11_24	Odtoky - použitelné váhy - významné mĚny

Ěást: 3 - Pøítoky

Pøioazené datové oblasti:

Pøoadí	Kód	Název
1	LIS11_31	Pøítoky - všechny mĚny v CZK
2	LIS11_32	Pøítoky - významné mĚny
3	LIS11_33	Pøítoky - použitelné váhy - všechny mĚny v CZK
4	LIS11_34	Pøítoky - použitelné váhy - významné mĚny

Ěást: 4 - VýmĚna kolaterálů

Pøioazené datové oblasti:

Pøoadí	Kód	Název
1	LIS11_41	VýmĚna kolaterálů - všechny mĚny v CZK
2	LIS11_42	VýmĚna kolaterálů - významné mĚny

Ěást: 5 - Výpočet ukazatele krytí likvidity

Pøioazené datové oblasti:

Pøoadí	Kód	Název
1	LIS11_51	Výpočet ukazatele krytí likvidity - všechny mĚny v CZK
2	LIS11_52	Výpočet ukazatele krytí likvidity - významné mĚny

Vykaz.povinnost: VP_LISIFE11_1

Název : Vykazovací povinnost pro LISIFE11_vykazující osoba

Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	Ě	Hodnota	Název hodnoty
P0002	Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt	=	9999	Technologický subjekt
P0046	Rozsah vykazování podle území	E	ZSVET	Údaje za Ěeskou republiku a zahraničí
P0053	Stav ke dni	E	d1_I1	Datum ve tvaru YYYYMMDD z pøípustného intervalu

Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	Ě	Hodnota	Název hodnoty
P0012	Periodicita	=	S_M_NV	Mísíení, jinak na vyžádání
P0060	Termín pøedkládání	E	ZM_88	do 30. kalendářního dne násl. měsíce, na vyžádání

Poznámka:

Kód: LISIFE11

Akronym: LIS (ĚNB) 11-12

Název: Likvidita podle DA

Verze:1.0

Stav:Projektovaný

Platnost od:

Zdroj:

Garant včného obsahu :Hlavatý/odb. 561

Garant metodického popisu:Žulavská, Pokorná/odb.396