

| |
|--|
| POPIS INFORMAČNÍCH PRVKŮ DATOVÉ OBLASTI V DATOVÉM SOUBORU |
|--|

Kód DS: COSIFE60

Akronym DS: COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_11

Název DO: Ztráty z pohledávek krytých zástavním právem k nemovitosti

Kód IP: CRR0163

Akronym IP:

Název IP: Ztráta z úvěrů do výše referenčního podílu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 101 (1) (a) a (d) CRR.

Vyazuje se hodnota všech ztrát včetně ztrát z pronajatého majetku pocházejících z expozic, se kterými se zachází podle části třetí hlavy II CRR, a které jsou zajištěny obytnými nemovitostmi (do výše 80 % tržní hodnoty nebo 80 % zástavní hodnoty podle čl. 101 (1) (a) CRR) nebo obchodními nemovitostmi (do výše 50 % tržní hodnoty nebo 60 % zástavní hodnoty podle čl. 101 (1) (d) CRR) do výše části, která je považována za plně zajištěnou podle čl. 124 (1) CRR.

Vyazují se ekonomické ztráty podle čl. 5 (2) CRR, které se určí z účetní hodnoty expozice ke dni vykazování. Zahrnují alespoň výtěžek z realizace kolaterálu, přímé náklady (vč. zaplacených úroků a nákladů spojených s likvidací/realizací kolaterálu a nepřímé náklady, vč. operačních nákladů na vypořádání. Všechny výše uvedené položky musí být diskontovány ke dni vykazování. Zahrnují se i kurzové rozdíly, pokud je expozice nebo kolaterál veden v cizí měně. Nezahrnují se výnosy z jiných zdrojů (např. bankovních záruk, pojištění atd.). Ztráta z jedné pozice se nesmí kompenzovat ziskem z druhé pozice.

Pro určení části expozice zajištěné nemovitostí se použije poslední ocenění přede dnem vykazování, pro určení ekonomické ztráty ocenění provedené po selhání expozice. Zástavní hodnota nemovitosti a tržní hodnota nemovitosti jsou definovány v čl. 4 (74) a (76) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0025 P0611 P0624

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60

Akronym DS: COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_11

Název DO: Ztráty z pohledávek krytých zástavním právem k nemovitosti

Kód IP: CRR0164

Akronym IP:

Název IP: Ztráta z úvěrů do výše referenčního podílu / z toho: ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 101 (1) (a) a (d) CRR.

Vyazuje se hodnota všech ztrát včetně ztrát z pronajatého majetku pocházejících z expozic, se kterými se zachází podle části třetí hlavy II CRR, a které jsou zajištěny obytnými nemovitostmi (do výše 80 % tržní hodnoty nebo 80 % zástavní hodnoty podle čl. 101 (1) (a) CRR) nebo obchodními nemovitostmi (do výše 50 % tržní hodnoty nebo 60 % zástavní hodnoty podle čl. 101 (1) (d) CRR) do výše části, která je považována za plně zajištěnou podle čl. 124 (1) CRR, kde hodnota kolaterálu byla stanovena ve výši zástavní hodnoty nemovitosti.

Vyazují se ekonomické ztráty podle čl. 5 (2) CRR, která se určí z účetní hodnoty expozice ke dni vykazování. Zahrnuj je alespoň výtěžek z realizace kolaterálu, přímé náklady (vč. zaplacených úroků a nákladů spojených s likvidací/realizací kolaterálu a nepřímé náklady vč. operačních nákladů na vypořádání. Všechny výše uvedené položky musí být diskontovány ke dni vykazování. Zahrnují se i kurzové rozdíly, pokud je expozice nebo kolaterál veden v cizí měně. Nezahrnují se výnosy z jiných zdrojů (např. bankovních záruk, pojištění atd.). Ztráta z jedné pozice se nesmí kompenzovat ziskem z druhé pozice.

Pro určení části expozice zajištěné nemovitostí se použije poslední ocenění přede dnem vykazování, pro určení ekonomické ztráty ocenění provedené po selhání expozice. Zástavní hodnota nemovitosti a tržní hodnota nemovitosti jsou definovány v čl. 4 (74) a (76) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0025 P0611 P0624

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60

Akronym DS: COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_11

Název DO: Ztráty z pohledávek krytých zástavním právem k nemovitosti

Kód IP: CRR0165

Akronym IP:

Název IP: Ztráta z úvěrů celkem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 101 (1) (b) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota všech ztrát pocházejících z poskytování úvěrů zajištěných obytnou nebo obchodní nemovitostí do výše části, která je považována za plně zajištěnou podle čl. 124 (1) CRR.

Vyazují se ekonomické ztráty podle čl. 5 (2) CRR, která se určí z účetní hodnoty expozice ke dni vykazování. Zahrnuje alespoň výtěžek z realizace kolaterálu, přímé náklady (vč. zaplacených úroků a nákladů spojených s likvidací/realizací kolaterálu a nepřímé náklady vč. operačních nákladů na vypořádání. Všechny výše uvedené položky musí být diskontovány ke dni vykazování. Zahrnují se i kurzové rozdíly, pokud je expozice nebo kolaterál veden v cizí měně. Nezahrnují se výnosy z jiných zdrojů (např. bankovních záruk, pojištění atd.). Ztráta z jedné pozice se nesmí kompenzovat ziskem z druhé pozice.

Pro určení části expozice zajištěné nemovitostí se použije poslední ocenění přede dnem vykazování, pro určení ekonomické ztráty ocenění provedené po selhání expozice. Zástavní hodnota nemovitostí a tržní hodnota nemovitostí jsou definovány v čl. 4 (74) a (76) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0025 P0611 P0624

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009 (CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_11
Název DO: Ztráty z pohledávek krytých zástavním právem k nemovitosti
Kód IP: CRR0166 **Akronym IP:**
Název IP: Ztráta celkem / z toho: ztráta z nemovitosti oceněné zástavní

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 101 (1) (b) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota všech ztrát pocházejících z poskytování úvěrů zajištěných obytnou nebo obchodní nemovitostí do výše části, která je považována za plně zajištěnou podle čl. 124 (1) CRR a kde hodnota kolaterálu byla stanovena ve výši zástavní hodnoty nemovitosti.
Vykazují se ekonomické ztráty podle čl. 5 (2) CRR, která se určí z účetní hodnoty expozice ke dni vykazování. Zahrnuje alespoň výtěžek z realizace kolaterálu, přímé náklady (vč. zaplacených úroků a nákladů spojených s likvidací/realizací kolaterálu a nepřímé náklady vč. operačních nákladů na vypořádání. Všechny výše uvedené položky musí být diskontovány ke dni vykazování. Zahrnují se i kurzové rozdíly, pokud je expozice nebo kolaterál veden v cizí měně. Nezahrnují se výnosy z jiných zdrojů (např. bankovních záruk, pojištění atd.). Ztráta z jedné pozice se nesmí kompenzovat ziskem z druhé pozice.
Pro určení části expozice zajištěné nemovitostí se použije poslední ocenění přede dnem vykazování, pro určení ekonomické ztráty ocenění provedené po selhání expozice. Zástavní hodnota nemovitosti a tržní hodnota nemovitosti jsou definovány v čl. 4 (74) a (76) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0025 P0611 P0624

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009 (CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_11
Název DO: Ztráty z pohledávek krytých zástavním právem k nemovitosti

Kód IP: CRR0167 **Akronym IP:**
Název IP: Expozice celkem

Charakteristika:

Vyazuje se ta část hodnoty expozice, se kterou se zachází podle části třetí hlavy II CRR, a která je plně a zcela zajištěna nemovitostmi. Nezahrnuje se nezajištěná část hodnoty expozice.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0025 P0611 P0624

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009 (CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0001 **Akronym IP:**
Název IP: Transakce

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 4 (37) a (39) až (40) CRR.

Položky:

S - sekuritizace

R - resekuritizace

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60

Akronym DS: COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_21

Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0002

Akronym IP:

Název IP: Aplikovaný typ retence

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 393 až čl. 399 CRR.

Vyazuje se typ retence čistého ekonomického podílu pro každé původní schéma sekuritizace podle čl. 394 (1) CRR.

Vyazující subjekt vybírá z následujících hodnot:

A - Vertikální řez (sekuritizované pozice): podle čl. 394 (1) písm. a) CRR; použije se v případě, kdy se jedná o ponechání nejméně 5 % nominální hodnoty každé tranše prodané investorům či na ně převedené. Tento typ vertikálního řezu se použije v případě, že sekuritizací dochází k významnému transferu rizika, a tedy se řídí přílohou IX CRR,

A1 - Vertikální řez (sekuritizované expozice): podle čl. 394 (1) písm. a) CRR; použije se v případě ponechání nejméně 5 % hodnoty kreditního rizika každé sekuritizované podkladové expozice, přičemž takto ponechané kreditní riziko je vždy rovnocenné nebo je podřízeno kreditnímu riziku, které bylo sekuritizováno s ohledem na ty samé expozice. Tento typ vertikálního řezu se použije v případě, že sekuritizací nedochází k významnému transferu rizika, a tedy se řídí podle příloh VI až VIII CRR),

B - Revolvingové sekuritizované expozice: podle čl. 394 (1) písm. b) CRR; použije se v případě ponechání podílu původce ve výši nejméně 5 % nominální hodnoty revolvingových sekuritizovaných expozic,

C - Rozvahové sekuritizované expozice: podle čl. 394 (1) písm. c) CRR; použije se v případě ponechání náhodně zvolených expozic, odpovídajících nejméně 5 % nominální hodnoty sekuritizovaných expozic, pokud by tyto expozice jinak byly sekuritizovány v rámci sekuritizace za předpokladu, že počet expozic určených na počátku k sekuritizaci činí nejméně 100,

D - Tranše první ztráty: podle čl. 394 (1) písm. d) CRR; použije se v případě ponechání první ztrátové tranše a případně jiných tranší, které mají stejný nebo horší profil rizika než tranše převedené na investory nebo jím prodané a nejsou splatné dříve než tyto tranše tak, aby ponechané expozice v celkovém součtu činily nejméně 5 % nominální hodnoty sekuritizovaných expozic,

E - Vyňaté sekuritizované expozice: použije se pro sekuritizované expozice, na které se vztahuje čl. 394 (3) CRR,

N - Neaplikovatelné: použije se pro sekuritizované expozice, na které se vztahuje čl. 393 CRR,

U - V porušení nebo neznámý: použije se v případě, kdy vyazující subjekt není schopen s jistotou určit, jaký typ retence byl na sekuritizovanou pozici aplikován nebo použitá retence není v souladu s retenčními požadavky.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail
Kód IP: CRR0002 **Akronym IP:**
Název IP: Aplikovaný typ retence

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: CRR0003 **Akronym IP:**
Název IP: Procento retence v den vykazování

Charakteristika:

Vyazuje se procento retence významného ekonomického podílu původce, sponzora nebo původního věřitele na sekuritizaci ke dni sestavení výkazu. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se uvede retence ve výši 0 %.
Nevyplňuje se v případě, že aplikovaný typ retence nabývá hodnot "E - Vyňaté sekuritizace" nebo "N - Neaplikovatelné".

Hodnota je uvedena v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0004 **Akronym IP:**
Název IP: Soulad s retenčními požadavky

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 394 (1) CRR.
Vykazuje se, zda daná sekuritizace je v souladu s retenčními požadavky podle čl. 394 (1) CRR.
Vykazující subjekt vybírá z následujících hodnot:
Y - Ano
N - Ne
Nevyplňuje se v případě, že aplikovaný typ retence nabývá hodnot "E - Vyňaté sekuritizace" nebo "N - Neaplikovatelné".

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0005 **Akronym IP:**
Název IP: Role instituce

Charakteristika:

Vyazuje se role vykazujícího subjektu v dané sekuritizaci.
Vykazující subjekt vybírá z následujících hodnot:

O - Původce: podle definice v čl. 4 (42) CRR,

S - Sponzor: podle definice v čl. 4(43) CRR,

L - Původní věřitel: vykazující subjekt, na který se vztahují retenční požadavky stanovené v čl. 394 (1) CRR, a který současně není v roli původce nebo sponzora pro danou sekuritizaci,

I - Investor: je vykazující subjekt, na který se vztahují čl. 395 a čl. 396 CRR pro danou sekuritizaci.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0006 **Akronym IP:**
Název IP: Datum vzniku sekuritizace

Charakteristika:

Vyazuje se měsíc a rok vzniku sekuritizace (např. datum uzavření seskupení) ve formátu MM/RRRR. Nevyplňuje se u sekuritizací vytvořených v rámci ABCP programu. ABCP program (program komerčních papírů zajištěných aktivy) je definován v čl. 237 (9) CRR.

Datum vzniku jednotlivých sekuritizací se mezi vykazujícími obdobími nemění. V případě sekuritizací krytými otevřenými seskupeními je datem vzniku datum prvního vydání cenného papíru. Vyazuje se i v případě, že vykazující subjekt v této sekuritizaci nadržuje žádnou pozici.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Date - Datum

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0007 **Akronym IP:**
Název IP: Celková výše sekuritizovaných expozic v den vzniku

Charakteristika:

Vyazuje se objem sekuritizovaných expozic v původní hodnotě před konverzními faktory v den vzniku sekuritizace. Nevyplňuje se u sekuritizací vytvořených v rámci ABCP programu. ABCP program (program komerčních papírů zajištěných aktivy) je definován v čl. 237 (9) CRR.

V případě sekuritizací krytých otevřenými seskupeními se uvádí hodnota odpovídající hodnotě vykázané v den vzniku sekuritizace. V případě tradiční sekuritizace se nezahrnují žádná jiná aktiva sekuritizovaného seskupení. V případě, že na sekuritizaci participuje více institucí (tj. je zde více původců sekuritizace), vyazuje se pouze hodnota odpovídající podílu vykazujícího subjektu na sekuritizovaném portfoliu. V případě sekuritizace pasiv se uvádí pouze hodnota pasiv, která připadá na vykazující subjekt. Vyazuje se i v případě, že vykazující subjekt v této sekuritizaci nadrží žádnou pozici.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009 (CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0008 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / Celková hodnota

Charakteristika:

Vyazuje se celková nesplacená hodnota sekuritizovaných expozic k datu sestavení výkazu. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se uvádí celková hodnota sekuritizovaných expozic 0.

V případě, že na sekuritizaci participuje více institucí (tj. je zde více původců sekuritizace), vyazuje se pouze hodnota odpovídající podílu vykazujícího subjektu na této sekuritizaci. V případě sekuritizací, které jsou kryty uzavřenými seskupeními (tj. portfolio sekuritizovaných aktiv nemůže být rozšířeno po dni vzniku sekuritizace), se tato hodnota progresivně snižuje. Vyazuje se i v případě, že vykazující subjekt v této sekuritizaci nedrží žádnou pozici.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0009 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / Podíl instituce (%)

Charakteristika:

Vyazuje se podíl vykazujícího subjektu na portfoliu sekuritizovaných expozic ke dni sestavení výkazu. Standardně se vyazuje hodnota 100 % s výjimkou sekuritizací, na nichž participuje více institucí. V případě takovéto sekuritizace uvádí vykazující subjekt svůj aktuální podíl na sekuritizovaných expozicích.

Vyazuje se i v případě, že vykazující subjekt v této sekuritizaci nadrží žádnou pozici.

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0010 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / Typ seskupení

Charakteristika:

Vyazuje se informace charakterizující typ aktiv (hodnoty 01 až 09) nebo pasiv (hodnoty 10 a 11), které jsou zahrnuty v sekuritizované expozici.

Vyazující subjekt vybírá z následujících hodnot:

- 01 - Rezidenční hypotéky
- 02 - Komerční hypotéky
- 03 - Pohledávky z kreditních karet
- 04 - Leasing
- 05 - Korporátní úvěry nebo SME
- 06 - Spotřebitelské úvěry
- 07 - Pohledávky z obchodního styku
- 09 - Ostatní aktiva
- 10 - Kryté dluhopisy
- 11 - Ostatní závazky

V případě, že podkladové seskupení je kombinací výše uvedených typů aktiv, resp. pasiv, vyazující subjekt uvede typ seskupení, který je pro danou sekuritizaci nejvýznamnější. V případě resekuritizací se uvádí konečné podkladové seskupení. Treasury bondy a úvěrové dluhové cenné papíry jsou součástí kategorie "Ostatní závazky".

Pro sekuritizace kryté uzavřenými podkladovými seskupeními se typ podkladového seskupení v jednotlivých obdobích vykazování nesmí měnit.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:
P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0011 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / Aplikovaný přístup

Charakteristika:

Vyazuje se přístup k úvěrovému riziku, který vykazující subjekt aplikoval na sekuritizované expozice v den sestavení výkazu.

Vyazující subjekt vybírá z následujících hodnot:

S - standardizovaný přístup (přístup STA)

I - přístup založený na interním ratingu (přístup IRB)

M - kombinace standardizovaného přístupu a přístupu založeného na interním ratingu (přístup STA/IRB)

Vzhledem k vazbě na typ použitého účetního přístupu (parametr P0506) platí následující vazby:

- pokud je vyplněna hodnota S (STA přístup) a v parametru Účetní přístup (P0506) hodnota "P", pak je výpočet kapitálových požadavků zahrnut v datových oblastech COS30_51 až COS30_55,

- pokud je vyplněna hodnota I (IRB přístup) a v parametru Účetní přístup (P0506) hodnota "P", pak je výpočet kapitálových požadavků zahrnut v datových oblastech COS30_61 až COS30_65,

- pokud je vyplněna hodnota M a v parametru Účetní přístup (P0506) hodnota "P", pak je výpočet kapitálových požadavků zahrnut v datových oblastech COS30_51 až COS30_65.

Vyazuje se i v případě, že vykazující subjekt v této sekuritizaci nadrží žádnou pozici. Nevyazuje se v případě sekuritizace pasiv a v případě, kdy vykazující subjekt plní roli sponzora sekuritizace.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:
P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0012 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / Počet expozic

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 256 (1) CRR.

Vyazuje se interval, do kterého spadá počet expozic, které jsou zahrnuty do dané sekuritizace.

Vykazující subjekt vybírá z následujících hodnot:

A - (N<6); počet zahrnutých expozic je nižší než 6 včetně

B - (6≤N<34); počet zahrnutých expozic je vyšší než 6 a menší než 34 včetně

C - (34≤N≤100); počet zahrnutých expozic je vyšší než 34 a menší než 100 včetně

D - (100<N≤1000); počet zahrnutých expozic je vyšší než 100 a menší než 1 000 včetně

E - (N>1000); počet zahrnutých expozic je vyšší než 1000.

Vyplňují pouze subjekty, které používají přístup IRB k sekuritizovaným pozicím, tj. ve sl. 17 (CRR0011) je vyplněna hodnota "I". Nevyplňuje se v případě sekuritizace pasiv. V případě sekuritizace aktiv se nevyplňuje, pokud je kapitálový požadavek počítán na základě sekuritizovaných expozic (tj. sekuritizací nedochází k významnému transferu rizik a řídí se podle příloh VI až VIII CRR). Nevyplňuje se rovněž v případě, že vykazující subjekt v dané sekuritizaci nedorží žádnou pozici, nebo se jedná o investora.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0013 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / Země

Charakteristika:

Vyplňuje se podle ISO 3166-1.
Vykazuje se dvoumístný kód země původu konečného podkladového aktiva transakce, tj. země dlužníka původní expozice, která byla zahrnuta do sekuritizace (look-through). V případě, že má podkladové seskupení původ v různých zemích, vykazující subjekt uvede tu zemi, která má na podkladovém seskupení nejvyšší význam.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:
P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: CRR0014 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / ELGD (%)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 257 (1) CRR.
Vykazuje se vážená průměrná hodnota očekávané ztráty (ELGD), kde jako váhy se použijí expozice vůči jednotlivým dlužníkům (EAD). Vykazuje se pouze v případě, kdy vykazující subjekt používá v rámci přístupu IRB metodu regulačního vzorce.
Nevyplňuje se v případě sekuritizace pasiv. V případě aktiv se nevyplňuje, pokud je kapitálový požadavek počítán na základě sekuritizovaných expozic (tj. sekuritizací nedochází k významnému transferu rizik a řídí se podle příloh VI až VIII CRR). Nevyplňuje se rovněž v případě, že vykazující subjekt v sekuritizaci nedoručí žádnou pozici, a v případě, že se jedná o investora.

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0015 **Akronym IP:**
Název IP: (-) Sekuritizované expozice / Úprava ocenění expozic a rezer

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 155 CRR.

Vyazuje se hodnota úprav ocenění expozic a rezerv k podrozvahovým položkám v souladu s účetním rámcem, kterému vykazující subjekt podléhá. Úpravy ocenění zahrnují částky vykázané ve výsledku jako úvěrové ztráty z finančních aktiv od jejich počátečního zaúčtování v rozvaze (vč. ztrát z úvěrového rizika finančních aktiv oceňovaných reálnou hodnotou, které nemusí být odečteny z hodnoty expozice) plus diskonty z pořízených expozic v selhání podle článku 162 (1) CRR. Rezervy zahrnují akumulované částky úvěrových ztrát z podrozvahových položek.

Vyazuje se i v případě, že vykazující subjekt v této sekuritizaci nedrží žádnou pozici.

Nevyazuje se v případě sekuritizace pasiv a v případě, že vykazující subjekt plní v sekuritizaci roli sponzora.

Položka snižuje hodnotu expozice, proto se uvádí jako záporná hodnota (se znaménkem -).

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0016 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované expozice / Kapitálový požadavek před sekuritizací

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 237 CRR.

Vyazuje se součet hodnoty kapitálového požadavku pro expozice, které jsou podkladem dané sekuritizace vypočítaný tak, jako by tyto expozice nebyly předmětem sekuritizace a hodnoty očekávaných ztrát plynoucích z rizik těchto expozic (KIRB), vydělený celkovým objemem těchto expozic, které byly podkladem dané sekuritizace v době jejího vzniku. KIRB je definován v čl. 237 CRR. Nevypĺňuje se v případě sekuritizace pasiv a v případě, že vykazující subjekt plní v sekuritizaci roli sponzora. V případě sekuritizace aktiv se vyplňuje i v případě, že vykazující subjekt v této sekuritizaci nadrží žádnou pozici.

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0017_001 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Rozvahové položky / Senior

Charakteristika:

Vykazuje se souhrnná rizikově vážená hodnota všech rozvahových sekuritizovaných pozic, které v dané sekuritizaci nejsou zařazeny v tranších mezzanine a první ztráty.

Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0017 - Struktura sekuritizace

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0137(10) P0614(10)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0017_002 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Rozvahové položky / Mezzanine

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 238 (3) a 239 (3) CRR.
Vykazuje se souhrnná rizikově vážená hodnota všech rozvahových sekuritizovaných pozic, které jsou v dané sekuritizaci zařazeny v mezzanine tranších, tj. naplňují se v případě tradiční sekuritizace podle čl. 238 (3) CRR, resp. v případě syntetické sekuritizace podle čl. 239 (3) CRR.
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
CRR0017 - Struktura sekuritizace

Parametry informačního prvku:
P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0009(CZK) P0137(10) P0614(20)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0017_003 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Rozvahové položky / První ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 237 (14) CRR.
Vykazuje se souhrnná rizikově vážená hodnota všech rozvahových sekuritizovaných pozic, které jsou zařazeny do tranší první ztráty podle čl. 237 (14) CRR. V případě, že na sekuritizaci tranší první ztráty participuje více institucí, vyplní se pouze hodnota odpovídající podílu vykazujícího subjektu, resp. hodnota tomuto subjektu připisována.
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
CRR0017 - Struktura sekuritizace

Parametry informačního prvku:
P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0009(CZK) P0137(10) P0614(30)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0017_004 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Podrozvahové položky a deriváty / S

Charakteristika:

Vyazuje se souhrnná rizikově vážená hodnota všech podrozvahových položek a derivátů, které nejsou zařazeny v tranších mezzanine a první ztráty. Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
CRR0017 - Struktura sekuritizace

Parametry informačního prvku:
P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0009(CZK) P0137(S_DERAPR) P0614(10)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0017_005 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Podrozvahové položky a deriváty / M

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 238 (3) a 239 (3) CRR.
Vykazuje se souhrnná rizikově vážená hodnota všech podrozvahových položek a derivátů, které jsou v dané sekuritizaci zařazeny v mezzanine tranších, tj. naplňují v případě tradiční sekuritizace čl. 238 (3) CRR, resp. v případě syntetické sekuritizace čl. 239 (3) CRR.
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
CRR0017 - Struktura sekuritizace

Parametry informačního prvku:
P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0009(CZK) P0137(S_DERAPR) P0614(20)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0017_006 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Podrozvahové položky a deriváty / P

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 237 (14) CRR.
Vykazuje se souhrnná rizikově vážená hodnota všech podrozvahových položek a derivátů, které jsou zařazeny do tranší první ztráty podle čl. 237 (14) CRR. V případě, že na sekuritizaci tranší první ztráty participuje více institucí, vyplní se pouze hodnota odpovídající podílu vykazujícího subjektu, resp. hodnota tomuto subjektu připisována.
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
CRR0017 - Struktura sekuritizace

Parametry informačního prvku:
P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0009(CZK) P0137(S_DERAPR) P0614(30)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0018 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Nejbližší předpokládaný datum splat

Charakteristika:

Vyazuje se pravděpodobný datum splatnosti celé sekuritizace podle smluvních podmínek a aktuálně očekávaných finančních podmínek. Zpravidla se uvádí dřívější datum z následujících:

(i) datum, kdy může být prvně proveden zpětný odkup (čl. 237 (2) CRR), přičemž se bere v úvahu splatnost podkladových seskupení, očekávané sazby pro předčasné splacení a případné aktivity vedoucí k obnovení podkladových seskupení,

(ii) datum, kdy původce sekuritizované expozice může prvně uplatnit jakoukoliv jinou opci zakotvenou v podmínkách sekuritizace, která by mohla vést k úplnému splacení sekuritizace.

Datum se uvádí ve tvaru RRRRMMDD

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Date - Datum

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: CRR0019 **Akronym IP:**
Název IP: Struktura sekuritizace / Konečný datum splatnosti

Charakteristika:

Vyazuje se datum, kdy všechny jistiny a úroky sekuritizace musí být z právního hlediska splaceny podle dokumentace transakce.

Datum se uvádí ve tvaru RRRRMMDD

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Date - Datum

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0020_001 **Akronym IP:**
Název IP: *Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními f

Charakteristika:

Vykazují se sekuritizované rozvahové pozice v původní hodnotě před aplikací konverzních faktorů, které v dané sekuritizaci nejsou zařazeny v tranších mezzanine a první ztráty..

Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0020 - Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními faktory

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0137(10) P0614(10)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0020_002 **Akronym IP:**
Název IP: *Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními f

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 238 (3) a 239 (3) CRR.
Vykazují se sekuritizované rozvahové pozice v původní hodnotě, před aplikací konverzních faktorů, které jsou v dané sekuritizaci zařazeny v mezzanine tranších, tj. naplňují v případě tradiční sekuritizace čl. 238 (3) CRR, resp. v případě syntetické sekuritizace čl. 239 (3) CRR.
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0020 - Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními faktory

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0137(10) P0614(20)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0020_003 **Akronym IP:**
Název IP: *Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními f

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 237 (14) CRR.
Vykazují se sekuritizované rozvahové pozice v původní hodnotě, před aplikací konverzních faktorů, které jsou v dané sekuritizaci zařazeny do tranší první ztráty podle čl. 237 (14) CRR. V případě, že na sekuritizaci tranší první ztráty participuje více institucí, vyplní se pouze hodnota odpovídající podílu vykazujícího subjektu, resp. hodnota tomuto subjektu připisována.
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0020 - Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními faktory

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0137(10) P0614(30)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0020_004 **Akronym IP:**
Název IP: *Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními f

Charakteristika:

Vykazují se sekuritizované podrozvahové pozice a deriváty v původní hodnotě, před aplikací konverzních faktorů, které v dané sekuritizaci nejsou zařazeny v tranších mezzanine a první ztráty.

Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0020 - Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními faktory

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0137(S_DERAPR) P0614(10)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0020_005 **Akronym IP:**
Název IP: *Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními f

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 238 (3) a 239 (3) CRR.
Vykazují se sekuritizované podrozvahové pozice a deriváty v původní hodnotě, před aplikací konverzních faktorů, které jsou v dané sekuritizaci zařazeny v mezzanine tranších, tj. naplňují v případě tradiční sekuritizace čl. 238 (3) CRR, resp. v případě syntetické sekuritizace čl. 239 (3) CRR.
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0020 - Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními faktory

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0137(S_DERAPR) P0614(20)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0020_006 **Akronym IP:**
Název IP: *Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními f

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 237 (14) CRR.

Vykazují se sekuritizované podrozvahové pozice a deriváty v původní hodnotě, před aplikací konverzních faktorů, které jsou v dané sekuritizaci zařazeny do tranší první ztráty podle čl. 237 (14) CRR. V případě, že na sekuritizaci tranší první ztráty participuje více institucí, vyplní se pouze hodnota odpovídající podílu vykazujícího subjektu, resp. hodnota tomuto subjektu připisována.

Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0020 - Sekuritizované pozice / Původní expozice před konverzními faktory

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0137 P0605 P0606 P0607 P0611 P0614

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0137(S_DERAPR) P0614(30)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0021 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované pozice / Doplnující informace: Podrozkahové p

Charakteristika:

Vyplňuje se podle přílohy I CRR.

Vykazuje se původní hodnota sekuritizovaných pozic před aplikací konverzních faktorů držených jejich původcem, které jsou zajištěny přímými úvěrovými substituty. Za přímé úvěrové substituty se podle přílohy I CRR považují následující podrozkahové položky:

- záruky mající charakter úvěrových substitutů,
- neodvolatelné stand-by (záložní) akreditivy mající charakter úvěrových substitutů.

Tato hodnota je zahrnuta i v objemu relevantních sekuritizovaných expozic (CRR0020_4 až CRR_6).

Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009 (CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0022 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované pozice / Doplnující informace: Podrozkahové p

Charakteristika:

Vyplňuje se podle přílohy II CRR.

Vyazuje se původní hodnota sekuritizovaných expozic před aplikací konverzních faktorů držených jejich původcem, které jsou zajištěny úrokovými swapy (IRS) nebo měnovými swapy (CRS). Seznam derivátů, vč. jejich členění, je uveden v příloze II CRR.

Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0023 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované pozice / Doplnující informace: Podrozhové p

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 237 (3) a 250 (1) CRR.
Vykazuje se hodnota podrozhových sekuritizovaných expozic, které patří mezi uznatelné likviditní facility. Likviditní facility musí splňovat šest podmínek stanovených v čl. 250 (1) CRR, aby mohly být považované za uznatelné, a to bez ohledu na to, zda vykazující subjekt používá přístup STA nebo přístup IRB. Tato hodnota je zahrnuta i v objemu relevantních sekuritizovaných expozic (CRR0020_4 až CRR_6).
Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období, se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0024 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované pozice / Doplnující informace: Podrozkahové p

Charakteristika:

Uvádí se zbývající hodnota podrozkahových položek a derivátů, které nejsou uvedené ve sl. 37 (CRR0021), sl. 38 (CRR0022) a sl. 39 (CRR0023), jako např. neuznatelné likviditní facility (likviditní facility, které nesplňují podmínky stanovené v čl. 250 (1) CRR).

Tato hodnota je zahrnuta i v objemu relevantních sekuritizovaných expozic (CRR0020_4 až CRR_6).

Uvádí se hodnota ke dni vykazování. Pro sekuritizace, které byly vytvořeny i ukončeny v průběhu jednoho vykazovacího období. se jako celková hodnota sekuritizovaných pozic uvede 0.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009 (CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0025 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované pozice / Použitý konverzní faktor při předčas

Charakteristika:

Vykazuje se podle čl. 237 (12) a 251 (5) CRR (přístup STA), resp. čl. 260 (1) CRR (přístup IRB).

Vykazuje se konverzní faktor, který byl použit k vynásobení hodnoty podílu investorů na revolvingových expozicích s možností předčasného splacení podle čl. 251 (6) až (9) CRR..

Tento konverzní faktor se odvozuje od aktuálního průměru nadměrného rozpětí za tři měsíce podle čl. 251 (6) CRR. Nevykazuje se v případě sekuritizace pasiv.

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0026 **Akronym IP:**
Název IP: (-) Hodnota expozice odečtená z vlastního kapitálu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 253 CRR první odstavec (přístup STA), resp. čl. 261 (3) CRR (přístup IRB)

Vyazuje se hodnota expozic, u kterých se vykazující subjekt rozhodl uplatnit alternativní přístup pro sekuritizované pozice, kterým je přiřazena riziková váha 1250 %, kde je umožněno tuto pozici odečíst z vlastních zdrojů místo jejího zahrnutí do výpočtu hodnoty rizikově vážené expozice.

Položka snižuje hodnotu expozice, proto se uvádí jako záporná hodnota (se znaménkem -).

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0027 **Akronym IP:**
Název IP: Kapitálový požadavek před aplikací limitů celkem

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota kapitálového požadavku k dané sekuritizaci před aplikací limitů. Vyazuje se pouze v případě schémat s významným transferem rizika podle přílohy XI CRR (tj. kapitálové požadavky jsou vypočteny podle sekuritizovaných pozic). V případech, kde nedochází k významnému transferu rizika, tedy řídí se přílohami VI až VIII CRR (tj. kapitálové požadavky jsou vypočteny podle sekuritizovaných expozic) se hodnota nevyazuje. Nevyazuje se rovněž v případě sekuritizace pasiv.

Hodnota v tis. Kč a v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0028 **Akronym IP:**
Název IP: Kapitálový požadavek po aplikaci limitů celkem

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota kapitálového požadavku k dané sekuritizaci po aplikaci limitů. Vyazuje se pouze v případě schémat s významným transferem rizika podle přílohy XI CRR (tj. kapitálové požadavky jsou vypočteny podle skuritizovaných pozic). V případech, kde nedochází k významnému transferu rizika, tedy řídí se přílohami VI až VIII CRR (tj. kapitálové požadavky jsou vypočteny podle sekuritizovaných expozic), se hodnota nevykazuje. Nevykazuje se rovněž v případě sekuritizace pasiv.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: CRR0029 **Akronym IP:**
Název IP: Sekuritizované pozice v obchodním portfoliu / CTP/ Non-CTP

Charakteristika:

Vyazuje se informace o tom, zda daná sekuritizovaná pozice držená v obchodním portfoliu je zařazena do portfolia obchodování s korelací nebo nikoliv.

Vykazující subjekt si vybírá z následujících hodnot:

CTP - portfolio obchodování s korelací

NONCTP - ostatní mimo portfolio obchodování s korelací

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Varchar - Řetězec proměnlivé délky

Parametry informačního prvku:

P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0030_001 **Akronym IP:**
Název IP: Čisté dlouhé sekuritizované pozice v obchodním portfoliu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 316 až 318 a čl. 323 CRR.
Vykazují se čisté dlouhé sekuritizované pozice v obchodním portfoliu. Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 317 (2) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0030 - Čisté sekuritizované pozice v obchodním portfoliu

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0602 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: CRR0030_002 **Akronym IP:**
Název IP: Čisté krátké sekuritizované pozice v obchodním portfoliu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 316 až 318 a čl. 323 CRR.
Vykazují se čisté krátké sekuritizované pozice v obchodním portfoliu. Definice krátké pozice je uvedena v čl. 317 (2) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

CRR0030 - Čisté sekuritizované pozice v obchodním portfoliu

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0602 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_21
Název DO: Sekuritizace - detail

Kód IP: CRR0031 **Akronym IP:**
Název IP: Kapitálový požadavek k sekuritizaci (STA) celkem / Specifick

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota požadavku na vlastní kapitál v souladu s čl. 326 (5) CRR (pro přechodné období, tzn. do 31. 12. 2013), resp. čl. 326 (4) CRR (od 1. 1. 2014) pro sekuritizace v obchodním portfoliu, mimo portfolio obchodování s korelací dle čl. 397 CRR.

Pro sekuritizace zařazené do portfolia obchodování s korelací, dle čl. 397 CRR, je požadavek na vlastní kapitál stanoven jako vyšší z následujícího:

- (i) požadavek na vlastní kapitál za specifické riziko aplikovatelné pouze na dlouhé pozice,
- (ii) požadavek na vlastní kapitál za specifické riziko aplikovatelné pouze na krátké pozice,

Hodnota v tis. Kč nebo v přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0605 P0606 P0607 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0009(CZK)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0003 **Akronym IP:**
Název IP: Podnikové finance / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0004

Akronym IP:

Název IP: Podnikové finance / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0005 **Akronym IP:**
Název IP: Podnikové finance / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typu událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0006

Akronym IP:

Název IP: Podnikové finance / Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí : při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0007 **Akronym IP:**
Název IP: Obchodování na finančních trzích / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl.8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř.37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0008

Akronym IP:

Název IP: Obchodování na finančních trzích / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0009 **Akronym IP:**
Název IP: Obchodování na finančních trzích / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0010

Akronym IP:

Název IP: Obchodování na finančních trzích / Součet 5 nejvyšších ztrát

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 306(4) CRR, typy událostí v čl. 313 CRR.

Při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0011 **Akronym IP:**
Název IP: Retailové makléřství / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0012

Akronym IP:

Název IP: Retailové makléřství / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0013 **Akronym IP:**
Název IP: Retailové makléřství / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0014

Akronym IP:

Název IP: Retailové makléřství / Součet 5 nejvyšších ztrátových událos

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí : při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0015 **Akronym IP:**
Název IP: Komerční bankovníctví / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0016

Akronym IP:

Název IP: Komerční bankovníctví / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0017 **Akronym IP:**
Název IP: Komerční bankovníctví / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0018

Akronym IP:

Název IP: Komerční bankovníctví / Součet 5 nejvyšších ztrátových událo

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí : při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0019 **Akronym IP:**
Název IP: Retailové bankovníctví / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0020

Akronym IP:

Název IP: Retailové bankovníctví / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0021 **Akronym IP:**
Název IP: Retailové bankovníctví / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0022

Akronym IP:

Název IP: Retailové bankovníctví / Součet 5 nejvyšších ztrátových udál

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí : při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0023

Akronym IP:

Název IP: Provádění plateb a vypořádání / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vyazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0024

Akronym IP:

Název IP: Provádění plateb a vypořádání / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0025 **Akronym IP:**
Název IP: Provádění plateb a vypořádání / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0026

Akronym IP:

Název IP: Provádění plateb a vypořádání / Součet 5 nejvyšších ztrátový

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí : při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0027 **Akronym IP:**
Název IP: Služby z pověření / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0028 **Akronym IP:**
Název IP: Služby z pověření / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0029 **Akronym IP:**
Název IP: Služby z pověření / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0030

Akronym IP:

Název IP: Služby z pověření / Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí : při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0031 **Akronym IP:**
Název IP: Obhospodařování aktiv / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0032

Akronym IP:

Název IP: Obhospodařování aktiv / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0033 **Akronym IP:**
Název IP: Obhospodařování aktiv / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0034

Akronym IP:

Název IP: Obhospodařování aktiv / Součet 5 nejvyšších ztrátových událo

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, typy událostí v čl. 324 CRR.

Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí : při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0035 **Akronym IP:**
Název IP: Podnikové položky / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.
Dodatečná linie podnikání "podnikové položky" je definována v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) je přesným součtem počtu událostí za jednotlivé typy událostí v dané linii podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání (v celkovém součtu za všechny linie podnikání na ř. 37 se však uvádí skutečný počet událostí, tj. tento součet může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání).

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0036 **Akronym IP:**
Název IP: Podnikové položky / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR
Vykazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.
Dodatečná linie podnikání "podnikové položky" je definována v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota (sl. 8) celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0037 **Akronym IP:**
Název IP: Podnikové položky / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Dodatečná linie podnikání "podnikové položky" je definována v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Jako souhrnná hodnota se vykazuje (sl. 8) hodnota celkové ztráty té události, která je nejvyšší v dané linii podnikání. Vzhledem k tomu, že událost může mít dopad do více linií podnikání, může být souhrnná celková ztráta za všechny linie podnikání (ř. 39) vyšší než jednotlivé nejvyšší ztráty v jednotlivých liniích podnikání.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0038

Akronym IP:

Název IP: Podnikové položky / Součet 5 nejvyšších ztrátových událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Dodatečná linie podnikání "podnikové položky" je definována v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0039 **Akronym IP:**
Název IP: Linie podnikání celkem / Počet událostí

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se počet událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu událostí a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, dodatečná linie podnikání "podnikové položky" v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota na tomto řádku pro jednotlivé typy událostí (sloupce) je součtem počtu událostí v dané linii podnikání, pokud jsou všechny události zařazeny právě jen do jedné linie podnikání. V případě, že daná událost zasahuje do více linií podnikání, vykazuje se v počtu událostí v každé relevantní linii podnikání, ale v celkovém počtu událostí za všechny linie podnikání na tomto řádku se uvádí jen jednou. Tj. tento údaj může být nižší než součet jednotlivých hodnot podle linií podnikání.

Pro sloupec 8 platí toto: počet událostí je roven součtu počtu událostí uvedených na řádku 37 ve sloupcích 1 až 7, přičemž se předpokládá, že událost, která má vliv na více linií podnikání se započítá jen jednou. Zde vykázané číslo nemusí tedy souhlasit se součtem počtu událostí vykázaných ve sloupci 8 (na příslušných řádcích), kde jedna událost může mít vliv ve více liniích podnikání.

Hodnota v jednotkách.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_31
Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn
Kód IP: OPR0040 **Akronym IP:**
Název IP: Linie podnikání celkem / Celková ztráta

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.
Vykazuje se celkový objem ztráty z událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.
Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, dodatečná linie podnikání "podnikové položky" v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Souhrnná hodnota celkové ztráty je přesně rovna součtu vykázaných ztrát v jednotlivých typech událostí v dané linii podnikání. V případě, že událost zasahuje do více linií podnikání, rozloží se objem celkové ztráty proporcionálně do jednotlivých linií podnikání, tj. celkový součet za linie podnikání na ř. 38 odpovídá přesně součtu položek vykázaných v jednotlivých liniích podnikání.
Pro sloupec 8 platí toto: celková ztráta je rovna součtu celkových ztrát podle typu událostí uvedených na řádku 38 a zároveň součtu celkových ztrát podle linií podnikání uvedených ve sloupci 8.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0041

Akronym IP:

Název IP: Linie podnikání celkem / Nejvyšší ztrátová událost

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota nejvyšší ztrátové události, která překračuje vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání. Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, dodatečná linie podnikání "podnikové položky" v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Vyazuje se maximální jednotlivá ztráta stanovená pro všechny linie podnikání pro každý typ události. Tato hodnota může být vyšší než nejvyšší jednotlivá ztráta vykázaná pro každou linii podnikání, pokud událost má vliv na více linií podnikání.

Pro sloupec 8 platí toto: může nastat situace, že maximální jednotlivá ztráta v řádce 39 pro jednotlivé typy událostí je větší než maximální jednotlivá ztráta pro každou linii podnikání. Tedy hodnota této buňky bude rovna největší z hodnot maximální jednotlivé ztráty z řádce 39, přičemž tato hodnota není nutně rovna největší hodnotě jednotlivé ztráty ze sloupce 8.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02

Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou

Kód DO: COS60_31

Název DO: Velké ztráty podle linií podnikání a typů událostí v posledn

Kód IP: OPR0042

Akronym IP:

Název IP: Linie podnikání celkem / Součet 5 nejvyšších ztrátových udál

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 322 (3) (b), (c) a (e) CRR.

Vyazuje se hodnota součtu 5 nejvyšších ztrátových událostí, které překračují vykazujícím subjektem vnitřně stanovenou prahovou hodnotu pro velikost ztráty v daném typu události a linii podnikání.

Linie podnikání jsou definovány v tabulce č. 2 v čl. 317 (4) CRR, dodatečná linie podnikání "podnikové položky" v čl. 322 (3) (b), typy událostí v čl. 324 CRR.

Při výpočtu ukazatele se vždy vychází ze všech velkých ztrát ve sledovaném období v dané kombinaci třídění, resp. agregaci, tj. pro údaje v souhrnných řádcích a sloupcích neplatí žádné vazby.

Vyazuje se součet pěti největších ztrát pro všechny linie podnikání pro jednotlivé typy událostí. Tato hodnota může být vyšší než odpovídající hodnoty vykázané za jednotlivé podnikové linie. Tento součet musí být vykázan bez ohledu na počty ztrát.

Pro sloupec 8 platí toto: součet pěti největších ztrát vykázaný v této buňce je roven hodnotě součtu největších pěti ztrát vykázaných v celé matici. To znamená, že tato hodnota není nutně rovna ani maximu z řádku 40 ani maximu ze sloupce 8.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0621

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_32
Název DO: Velké ztráty - prahové hodnoty pro sběr dat

Kód IP: OPR0043 **Akronym IP:**
Název IP: Podnikové finance

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: OPR0044 **Akronym IP:**
Název IP: Obchodování na finančních trzích

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_32
Název DO: Velké ztráty - prahové hodnoty pro sběr dat

Kód IP: OPR0045 **Akronym IP:**
Název IP: Retailové makléřství

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: OPR0046 **Akronym IP:**
Název IP: Komerční bankovníctví

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_32
Název DO: Velké ztráty - prahové hodnoty pro sběr dat

Kód IP: OPR0047 **Akronym IP:**
Název IP: Retailové bankovníctví

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: OPR0048 **Akronym IP:**
Název IP: Provádění plateb a vypořádání

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_32
Název DO: Velké ztráty - prahové hodnoty pro sběr dat

Kód IP: OPR0049 **Akronym IP:**
Název IP: Služby z pověření

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód IP: OPR0050 **Akronym IP:**
Název IP: Obhospodařování aktiv (AM)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |

Kód DS: COSIFE60 **Akronym DS:** COS (ČNB) 60-02
Název DS: Detailní informace s pololetní periodicitou
Kód DO: COS60_32
Název DO: Velké ztráty - prahové hodnoty pro sběr dat

Kód IP: OPR0051 **Akronym IP:**
Název IP: Podnikové položky

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 317 (4), čl. 318 (1) až (2) a čl. 322 (3) (b) CRR.

Hodnota v tis. Kč nebo přepočtu na tis. Kč.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0019 P0611 P0622

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

| | | |
|-------------------|---------------------------|---------------------|
| Verze: 1.0 | Stav: Projektovaný | Platnost od: |
| Zdroj: | Garant: / | |