

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR**Datový soubor:** LISIFE20**Akronym:** LIS (ČNB) 20_04**Název:** Stabilní financování**Datová oblast:** LIS20_11**Název:** Aktiva vyžadující stabilní financování - část 1**Charakteristika:**

Přehled části aktiv vyžadujících stabilní financování (zejména likvidní aktiva podle čl. 416 CRR, další cenné papíry a nástroje finančního trhu, majetkové cenné papíry nefinančních subjektu (hlavní index na regulovaných trzích) aj. Tato aktiva se uvádějí v pěti koších (dle čl. 428 (2) CRR) podle data jejich splatnosti nebo nejbližšího data kdy mohou být smluvně splaceny a rovněž podle stupně likviditní a úvěrové kvality aktiv.

Pro opce realizovatelné na přání vykazující osoby, musí vykazující osoba brát v úvahu reputační faktory, které mohou omezit schopnost vykazující osoby opci realizovat. Zejména pokud třetí strana očekává, že opce nebude realizována, musí vykazující osoba počítat s tímto chováním pro účel vykazování aktiv v této datové oblasti.

Aktiva se vykazují podle zbytkové smluvní splatnosti, nikoliv podle očekávané skutečnosti.

S aktivy, které mají vazbu na zajištěné úvěrové transakce a transakce na kapitálovém trhu podle čl. 192 CRR se zachází následovně: 1) nezahrnují se aktiva půjčena (v rámci reverzních repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba nevlastní; 2) zahrnují se aktiva zapůjčena (v rámci repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba stále vlastní; 3) zahrnují se zatížené cenné papíry zapůjčené v rámci repo obchodů, která vykazující osoba stále vlastní a která stále eviduje ve své rozvaze; tyto zatížené cenné papíry se vykazují v relevantní kategorii pro stabilní financování.

Každá kategorie aktiv se ve vazbě na čl. 510 CRR vykazuje v členění podle zatížení: aktiva nezatížená a aktiva zatížená v rozpadu podle doby, po kterou jsou aktiva zatížena.

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

- CRR odkazuje na Nařízení Evropského parlamentu a rady č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 o omezitelných požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na Přílohu XII a XIII (část Stable Funding) implementačních technických standardů .

Datovou oblast vyplňují všechny úvěrové instituce, tj. banky a družstevní záložny.

Obchodníci s cennými papíry toto hlášení nevyplňují - zatím je to v jednání, bude se řešit blíž ke konci roku 2013, možná i později (zatím tento návrh nikdo nerozporoval).

V případě likviditní podskupiny se postupuje dle rozhodnutí ČNB individuálně (subjekt může být úplně nebo částečně zproštěn povinnosti vykazovat toto hlášení na solo bázi).

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název	Datový typ údajů
LCR0335	Likvidní aktiva podle čl. 416	n11T
LCR0336	Hotovost	n11T
LCR0337	Expozice vůči centrálním bankám	n11T

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0338	Expozice vůči centrálním bankám pro krizovou situaci	n11T
LCR0339	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo jimi zar	n11T
LCR0340	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou	n11T
LCR0341	Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou	n11T
LCR0342	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo	n11T
LCR0343	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru	n11T
LCR0344	Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt	n11T
LCR0345	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB nebo jimi zaručené	n11T
LCR0346	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB	n11T
LCR0347	Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB	n11T
LCR0348	- Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených nezatížené	n11T
LCR0349	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené do	n11T
LCR0350	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB zatížené od 3 měsíců do 6 m	n11T
LCR0351	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené od	n11T
LCR0352	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené od	n11T
LCR0353	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené nad	n11T
LCR0354	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabili	n11T
LCR0355	Pohledávky za nástrojem fin. stability nebo mechanismem stab	n11T
LCR0356	Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s	n11T
LCR0357	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	n11T
LCR0358	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad. aktivy podle č	n11T
LCR0359	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad. aktivy podle čl	n11T
LCR0360	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad.aktivy podle čl.	n11T
LCR0361	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	n11T
LCR0362	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	n11T
LCR0363	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	n11T
LCR0364	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	n11T
LCR0365	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	n11T
LCR0366	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	n11T
LCR0367	Vklady a likvidní financování od ústřední úvěr. instituce ne	n11T
LCR0368	Vklady u ústřední úvěrové instituce	n11T
LCR0369	Likvidní financování od ústřední úvěr.instituce nebo členů s	n11T
LCR0370	Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou	n11T
LCR0371	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky	n11T
LCR0372	Ostatní nezatížená převoditelná aktiva představující pohledá	n11T

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0373	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatížen	n11T
LCR0374	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatížen	n11T
LCR0375	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatížen	n11T
LCR0376	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatíže	n11T
LCR0377	Ostatní převoditelná aktiva zatížená nad 12 měsíců představu	n11T
LCR0378	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků	n11T
LCR0379	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků nezatížené	n11T
LCR0380	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené do 3 měsí	n11T
LCR0381	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené od 3 do 6	n11T
LCR0382	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené od 6 do 9	n11T
LCR0383	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené od 9 do 1	n11T
LCR0384	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené nad 12 mě	n11T
LCR0385	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI	n11T
LCR0386	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI nezatí	n11T
LCR0387	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0388	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0389	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0390	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0391	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0392	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI	n11T
LCR0393	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI nezatí	n11T
LCR0394	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0395	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0396	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0397	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0398	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže	n11T
LCR0399	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)	n11T
LCR0400	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) nezat	n11T
LCR0401	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží	n11T
LCR0402	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží	n11T
LCR0403	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží	n11T
LCR0404	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží	n11T
LCR0405	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží	n11T
LCR0406	Ostatní dluhové CP vydané ÚI	n11T
LCR0407	Ostatní dluhové CP vydané ÚI nezatížené	n11T

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0408	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené do 3 měsíců	n11T
LCR0409	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené od 3 do 6 měsíců	n11T
LCR0410	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené od 6 do 9 měsíců	n11T
LCR0411	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0412	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené nad 12 měsíců	n11T
LCR0413	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěrové kvality	n11T
LCR0414	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1n	n11T
LCR0415	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1	n11T
LCR0416	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1	n11T
LCR0417	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1	n11T
LCR0418	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1	n11T
LCR0419	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1	n11T
LCR0420	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěrové kvality	n11T
LCR0421	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2	n11T
LCR0422	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2	n11T
LCR0423	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2	n11T
LCR0424	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2	n11T
LCR0425	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2	n11T
LCR0426	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2	n11T
LCR0427	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěrové kval	n11T
LCR0428	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit	n11T
LCR0429	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit	n11T
LCR0430	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit	n11T
LCR0431	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit	n11T
LCR0432	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit	n11T
LCR0433	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit	n11T
LCR0434	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul	n11T
LCR0435	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul	n11T
LCR0436	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul	n11T
LCR0437	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul	n11T
LCR0438	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul	n11T
LCR0439	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul	n11T
LCR0440	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul	n11T
LCR0441	Ostatní majetkové cenné papíry	n11T
LCR0442	Ostatní majetkové CP nezatížené	n11T

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0443	Ostatní majetkové CP zatížené do 3 měsíců	n11T
LCR0444	Ostatní majetkové CP zatížené od 3 do 6 měsíců	n11T
LCR0445	Ostatní majetkové CP zatížené od 6 do 9 měsíců	n11T
LCR0446	Ostatní majetkové CP zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0447	Ostatní majetkové CP zatížené nad 12 měsíců	n11T
LCR0448	Zlato	n11T
LCR0449	Zlato nezatížené	n11T
LCR0450	Zlato zatížené do 3 měsíců	n11T
LCR0451	Zlato zatížené od 3 měsíců do 6 měsíců	n11T
LCR0452	Zlato zatížené od 6 měsíců do 9 měsíců	n11T
LCR0453	Zlato zatížené od 9 měsíců do 12 měsíců	n11T
LCR0454	Zlato zatížené nad 12 měsíců	n11T
LCR0455	Ostatní drahé kovy	n11T
LCR0456	Ostatní drahé kovy nezatížené	n11T
LCR0457	Ostatní drahé kovy zatížené do 3 měsíců	n11T
LCR0458	Ostatní drahé kovy zatížené od 3 měsíců do 6 měsíců	n11T
LCR0459	Ostatní drahé kovy zatížené od 6 měsíců do 9 měsíců	n11T
LCR0460	Ostatní drahé kovy zatížené od 9 měsíců do 12 měsíců	n11T
LCR0461	Ostatní drahé kovy zatížené nad 12 měsíců	n11T
LCR0547	Položky vyžadující stabilní financování	

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK	Měny pro likviditu
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Výčet : Z_PÄSSPL	Pásma splatnosti pro stabilní financování
P0635	Likvidita a stabilní financování	Výčet : Z_AKTVYSLIK	Aktiva vysoké likvidity a ostatní aktiva

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 120	Poslední den sledovaného čtvrtletí
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_11

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Stav:Projektovaný

Platnost od:

Zdroj:

Garant: /

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_12

Název: Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky

Charakteristika:

Přehled části aktiv vyžadujících stabilní financování (zejména neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky, pohledávky z derivátů, aktiva odečtená od kapitálu aj. Tato aktiva se uvádějí v pěti koších (dle čl. 428 (2) CRR) podle data jejich splatnosti nebo nejbližšího data kdy mohou být smluvně splaceny.

Pro opce realizovatelné na přání vykazující osoby, musí vykazující osoba brát v úvahu reputační faktory, které mohou omezit schopnost vykazující osoby opci realizovat. Zejména pokud třetí strana očekává, že opce nebude realizována, musí vykazující osoba počítat s tímto chováním pro účel vykazování aktiv v této datové oblasti.

Aktiva se vykazují podle zbytkové smluvní splatnosti, nikoliv podle očekávané skutečnosti.

Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky se vykazují v členění podle protistrany a dále ve vazbě na čl. 510 CRR v členění podle zatížení: aktiva nezatížená a aktiva zatížená v rozpadu podle doby, po kterou jsou aktiva zatížena.

S aktivity, které mají vazbu na zajištěné úvěrové transakce a transakce na kapitálovém trhu podle čl. 192 CRR se zachází následovně: 1) nezahrnují se aktiva půjčena (v rámci reverzních repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba nevlastní; 2) zahrnují se aktiva zapůjčena (v rámci repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba stále vlastní; 3) zahrnují se zatížené cenné papíry zapůjčené v rámci repo obchodů, která vykazující osoba stále vlastní a která stále eviduje ve své rozvaze; tyto zatížené cenné papíry se vykazují v relevantní kategorii pro stabilní financování.

V dané datové oblasti se uvádějí pohledávky z derivátů (čisté derivátové položky na straně aktiv, které vykazující osoba počítá podle regulačních pravidel započtení, nikoliv podle účetních pravidel).

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

- CRR odkazuje na Nařízení Evropského parlamentu a rady č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 o obezřetnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na Přílohu XII a XIII (část Stable Funding) implementačních technických standardů .

Datovou oblast vyplňují všechny úvěrové instituce, tj. banky a družstevní záložny.

Obchodníci s cennými papíry toto hlášení nevyplňují - zatím je to v jednání, bude se řešit blíž ke konci roku 2013, možná i později (zatím tento návrh nikdo nerozporoval).

V případě likviditní podskupiny se postupuje dle rozhodnutí ČNB individuálně (subjekt může být úplně nebo částečně zproštěn povinnosti vykazovat toto hlášení na solo bázi).

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LICR0462	Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky	n11T

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_12

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0463	Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky vůči nepodnikajícím FO	n11T
LCR0464	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči nepodnikajícím	n11T
LCR0465	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči	n11T
LCR0466	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v	n11T
LCR0467	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v	n11T
LCR0468	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0469	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči	n11T
LCR0470	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči retailovým SME	n11T
LCR0471	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči retailovým	n11T
LCR0472	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči r	n11T
LCR0473	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v	n11T
LCR0474	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v	n11T
LCR0475	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0476	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené ve lhůtě nad 12 mě	n11T
LCR0477	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči ústř.vládám, centr. ba	n11T
LCR0478	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči ústř.vládám	n11T
LCR0479	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči ú	n11T
LCR0480	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v	n11T
LCR0481	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v	n11T
LCR0482	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0483	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči	n11T
LCR0484	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči nefinančním zákazníkům	n11T
LCR0485	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči nefinančním	n11T
LCR0486	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči n	n11T
LCR0487	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v	n11T
LCR0488	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v	n11T
LCR0489	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0490	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči	n11T
LCR0491	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči úvěrovým institucím	n11T
LCR0492	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči ÚI	n11T
LCR0493	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči Ú	n11T
LCR0494	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v	n11T
LCR0495	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v	n11T
LCR0496	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0497	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči	n11T

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_12

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0498	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči finančním zákazníkům j	n11T
LCR0499	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči finančním z	n11T
LCR0500	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči f	n11T
LCR0501	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v	n11T
LCR0502	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v	n11T
LCR0503	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců	n11T
LCR0504	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči	n11T
LCR0505	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zajištěné nemovitostmi	n11T
LCR0506	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zajištěné obchodními nemovi	n11T
LCR0507	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zajištěné obytnými nemovito	n11T
LCR0508	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. spolufinancované krytými dl	n11T
LCR0509	Pohledávky z derivátů	n11T
LCR0510	Ostatní aktiva	n11T
LCR0511	Aktiva odečítaná od kapitálu	n11T
LCR0512	Nevyčerpané úvěrové přísliby se středním nebo středně nízkým	n11T
LCR0548	Položky vyžadující stabilní financování	n11T

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK	Měny pro likviditu
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Výčet : Z_PASSPL	Pásma splatnosti pro stabilní financování

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 120	Poslední den sledovaného čtvrtletí
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_12

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Stav:Projektovaný

Platnost od:

Zdroj:

Garant: /

Datová oblast: LIS20_21

Název: Položky zajišťující stabilní financování

Charakteristika:

Přehled položek vyžadujících stabilní financování (položky kapitálu po příp. odpočtu a závazky nezahrnuté do kapitálu). Všechny tyto položky se uvádějí v pěti koších (dle čl. 427 (2) CRR) podle data jejich splatnosti nebo nejbližšího data kdy mohou být smluvně splaceny. Vklady na viděnou se vykazují v koši se splatností do 3 měsíců. Vykazující osoba musí předpokládat, že investor splatí kupní opci v první možný den. Pro financování opcí realizovatelných na přání vykazující osoby, je třeba brát v úvahu reputační faktor, které může omezit schopnost vykazující osoby opci realizovat. Zejména pokud trh očekává, že určité závazky budou splaceny před konečnou smluvní splatností, musí vykazující osoba počítat s tímto chováním trhu. Retailové vklady vykazované v dané datové oblasti (informační prvky LCR0519 - LCR0521) se posuzují z hlediska splatnosti stejně jako v hlášení o likviditě. V dané datové oblasti se uvádějí závazky z derivátů (čisté derivátové položky na straně závazků, které vykazující osoba počítá podle regulatorních pravidel započtení, nikoliv podle účetních pravidel).

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

- CRR odkazuje na Nařízení Evropského parlamentu a rady č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 o obezřetnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na Přílohu XII a XIII (část Stable Funding) implementačních technických standardů.

Datovou oblast vyplňují všechny úvěrové instituce, tj. banky a družstevní záložny.

Obchodníci s cennými papíry toto hlášení nevyplňují - zatím je to v jednání, bude se řešit blíž ke konci roku 2013, možná i později (zatím tento návrh nikdo nerozporoval).

V případě likviditní podskupiny se postupuje dle rozhodnutí ČNB individuálně (subjekt může být úplně nebo částečně zproštěn povinnosti vykazovat toto hlášení na solo bázi).

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0513	Kapitál	n11T
LCR0514	Tier 1 (T1) kapitál	n11T
LCR0515	Tier 2 (T2) kapitál	n11T
LCR0516	Prioritní akcie a kap.nástroje nad rámec T2 se splatností al	n11T
LCR0517	Závazky (bez kapitálu)	n11T
LCR0518	Retailové vklady	n11T
LCR0519	Pojištěné retailové vklady	n11T
LCR0520	Ostatní pojištěné a nepojištěné retailové vklady	n11T

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_21

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0521	Retailové vklady s vyšším odtokem	n11T
LCR0522	Závazky vůči nefinančním zákazníkům	n11T
LCR0523	Závazky vůči NZ ze zajištěných půjček a z transakcí na kap.	n11T
LCR0524	Závazky vůči NZ zajištěné aktivity s velmi vysokou likviditou	n11T
LCR0525	Závazky vůči NZ zajištěné aktivity s vysokou likviditou a úvěr	n11T
LCR0526	Závazky vůči NZ zajištěné ostatními aktivy	n11T
LCR0527	Závazky vůči NZ z nezajištěných úvěrů	n11T
LCR0528	Závazky vůči NZ se zacházením dle čl. 422 (3) nebo (4) CRR	n11T
LCR0529	Pojištěné závazky vůči NZ, které musí být drženy vkladatelem	n11T
LCR0530	Závazky vůči NZ v rámci institucionálního systému ochrany	n11T
LCR0531	Závazky vůči NZ k zajištění clearingů, úschovy, správy hotov	n11T
LCR0532	Závazky vůči finančním zákazníkům	n11T
LCR0533	Závazky vůči FZ ze zajištěných půjček a transakce na kap. tr	n11T
LCR0534	Závazky vůči FZ zajištěné aktivity s velmi vysokou likviditou	n11T
LCR0535	Závazky vůči FZ zajištěné aktivity s vysokou likviditou a úvěr	n11T
LCR0536	Závazky vůči FZ zajištěné ostatními aktivy	n11T
LCR0537	Závazky vůči FZ z nezajištěných půjček	n11T
LCR0538	Závazky vůči FZ se zacházením dle čl. 422 odst. (3) nebo (4)	n11T
LCR0539	Pojištěné závazky vůči FZ, které musí být drženy vkladatelem	n11T
LCR0540	Závazky vůči FZ v rámci institucionálního systému ochrany	n11T
LCR0541	Závazky vůči FZ k zajištění clearingů, úschovy, správy hotov	n11T
LCR0542	Závazky z krytých dluhopisů	n11T
LCR0543	Závazky z vydaných CP podle čl. 52 (4) směrnice 2009/65/ES	n11T
LCR0544	Ostatní závazky vyplývající z vydaných CP	n11T
LCR0545	Závazky ze splatných derivátových smluv	n11T
LCR0546	Všechny ostatní závazky	n11T
LCR0549	Položky zajišťující stabilní financování	n11T

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK	Měny pro likviditu
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Výčet : Z_PASSPL	Pásma splatnosti pro stabilní financování

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_21

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0011	Časová charakteristika	Položka : 120	Poslední den sledovaného čtvrtletí
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20_04

Datová oblast: LIS20_21

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Stav:Projektovaný

Platnost od:

Zdroj:

Garant: /