

**Kód: LISIFE20****Akronym: LIS (ČNB) 20\_04****Název: Stabilní financování****Charakteristika:**

Hlášení o stabilním financování na základě přímo účinného předpisu Evropské unie upravujícího obezřetnostní požadavky CRD IV/CRR. Je sestaveno na základě jednotného reportovacího rámce NSFR, který je součástí přímo účinných implementačních technických standardů (ITS) pro reporting v oblasti dohledu. Obsahuje informace potřebné pro výpočet požadavku k zajištění stabilního financování podle čl. 427 a čl. 428 CRR.

Hlášení se skládá ze 2 částí:

1. část - Aktiva vyžadující stabilní financování
2. část - Položky zajišťující stabilní financování

Část 1. zahrnuje přehled aktiv vyžadujících stabilní financování v členění (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.

Část 2. zahrnuje přehled položek zajišťujících stabilní financování v členění (dle čl. 427 (2) CRR) podle data jejich splatnosti nebo nejbližšího data kdy mohou být smluvně splaceny.

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.

Hlášení 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).

-----  
Na kons. bázi:

- vyplňují pouze mateřské instituce v EU, instituce kontrolované mateřskou FHS v EU a instituce kontrolované mateřskou smíšenou FHS v EU.
- v případě likviditní podskupiny vyplňují mateřské instituce, instituce kontrolované mateřskou FHS a instituce kontrolované mateřskou smíšenou FHS

**Části datového souboru:**

**Část:** 1 - Aktiva vyžadující stabilní financování

**Přiřazené datové oblasti:**

| Pořadí | Kód      | Název   |
|--------|----------|---|
| 1      | LIS20_11 | Aktiva vyžadující stabilní financování - část 1 |
| 2      | LIS20_12 | Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky           |

**Část:** 2 - Položky zajišťující stabilní financování

**Přiřazené datové oblasti:**

| Pořadí | Kód      | Název                                    |
|--------|----------|--|
| 1      | LIS20_21 | Položky zajišťující stabilní financování |

Kód: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20\_04

Název: Stabilní financování

Vykaz.povinnost: VP\_LISIFE20\_1

Název : Vykazovací povinnost pro LISIFE20\_banky

Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:

| Kód   | Název parametru                                | O | Hodnota | Název hodnoty                                   |
|-------|--|---|---------|---|
| P0002 | Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt | E | BANCR_1 | Banky se sídlem na území ČR bez ČNB             |
| P0046 | Rozsah vykazování podle území                  | E | ZSVET   | Údaje za Českou republiku a zahraničí           |
| P0053 | Stav ke dni                                    | E | d1_I1   | Datum ve tvaru YYYYMMDD z přípustného intervalu |

Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:

| Kód   | Název parametru    | O | Hodnota | Název hodnoty   |
|-------|--------------------|---|---------|---|
| P0012 | Periodicita        | = | S_Q_NV  | Čtvrtletně, jinak na vyžádání                               |
| P0060 | Termín předkládání | E | ZQ_90   | k 31.3. do 30.5., násl. Q do 11.8., 11.11. a 11.2., na vyž. |

Vykaz.povinnost: VP\_LISIFE20\_2

Název : Vykazovací povinnost pro LISIFE20\_DZ

Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:

| Kód   | Název parametru                                | O | Hodnota | Název hodnoty                                   |
|-------|--|---|---------|---|
| P0002 | Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt | E | Z_DZ_1  | Družstevní záložny                              |
| P0046 | Rozsah vykazování podle území                  | E | ZSVET   | Údaje za Českou republiku a zahraničí           |
| P0053 | Stav ke dni                                    | E | d1_I1   | Datum ve tvaru YYYYMMDD z přípustného intervalu |

Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:

| Kód   | Název parametru    | O | Hodnota | Název hodnoty   |
|-------|--------------------|---|---------|---|
| P0012 | Periodicita        | = | S_Q_NV  | Čtvrtletně, jinak na vyžádání                               |
| P0060 | Termín předkládání | E | ZQ_90   | k 31.3. do 30.5., násl. Q do 11.8., 11.11. a 11.2., na vyž. |

Poznámka:

|                            |                            |              |
|----------------------------|----------------------------|--------------|
| Verze:1.0                  | Stav:Projektovaný          | Platnost od: |
| Zdroj:                     |                            |              |
| Garant věcného obsahu      | :Žulavská, Pokorná/odb.563 |              |
| Garant metodického popisu: | Žulavská, Pokorná/odb.563  |              |