

**POPIS ČÍSELNÍKU****Kód:** BA0619**Akronym:** TRAN\_IN\_PO  
RT**Název:** Nevypořádané transakce**Charakteristika:**

Vyplňuje se podle čl. 378 CRR.

Nevypořádané transakce v investičním nebo v obchodním portfoliu.

**Použití číselníku v parametrech:**

P0619 Nevypořádané transakce

**Poznámka:****Výčet položek číselníku:**

Kód	Název položky
10	Nevypořádané transakce do 4 dní (faktor 0%) Vyplňuje se podle čl. 378 CRR Vykazují se transakce nevypořádané do 4 dnů včetně od data dodání, a to v hodnotě před uplatněním příslušného faktoru (0 %). Kapitálový požadavek k vypořádacímu riziku/riziku volných dodávek pro transakce nevypořádané do 4 dní se nestanovuje, proto se použije faktor 0%.
20	Nevypořádané transakce od 5 do 15 dní (faktor 8%) Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 378 CRR Vykazují se transakce, pro které se počítá kapitálový požadavek k vypořádacímu riziku, nevypořádané v termínu od 5 do 15 dnů včetně od data dodání, a to v hodnotě před uplatněním příslušného faktoru (8 %).
30	Nevypořádané transakce od 16 do 30 dní (faktor 50%) Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 378 CRR Vykazují se transakce, pro které se počítá kapitálový požadavek k vypořádacímu riziku, nevypořádané v termínu od 16 do 30 dní včetně od data dodání, a to v hodnotě před uplatněním příslušného faktoru (50 %).
40	Nevypořádané transakce od 31 do 45 dní (faktor 75%) Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 378 CRR Vykazují se transakce, pro které se počítá kapitálový požadavek k vypořádacímu riziku, nevypořádané v termínu od 31 do 40 dní včetně od data dodání, a to v hodnotě před uplatněním příslušného faktoru (75 %).
50	Nevypořádané transakce delší než 46 dní (faktor 100%) Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 378 CRR Vykazují se transakce, pro které se počítá kapitálový požadavek k vypořádacímu riziku, nevypořádané v termínu delším než 46 dní včetně od data dodání, a to v hodnotě před uplatněním příslušného faktoru (100 %).
S_NEVTRAN	Nevypořádané transakce celkem Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (c) (ii) a čl. 378 CRR. Vykazují se nevypořádané transakce celkem.

**Kód:** BA0619

**Akronym:** TRAN\_IN\_PO  
RT

**Verze:** 1.0

**Stav:** Projektovaný

**Platnost od:**

**Zdroj:**

**Garant:** /