

POPIS ČÍSELNÍKU**Kód:** BA0409**Akronym:** ZAJRIZ**Název:** Zajišťované riziko**Charakteristika:**

Zajišťovaná tržní rizika podle CRR

Použití číselníku v parametrech:

P0409 Zajišťované riziko

Poznámka:**Výčet položek číselníku:**

Kód	Název položky
10	Komoditní riziko Vyplňuje se podle čl. 363 (1) a 367 (2) CRR.
16	Úrokové riziko Vyplňuje se podle čl. 363 (1) CRR. Vykazuje se ta část pozičního rizika, která odpovídá rizikovým faktorům úrokového rizika specifikovaným v čl. 367 (2) CRR.
161	Obecné úrokové riziko Vyplňuje se podle čl. 362 CRR. Vykazuje se ta část pozičního rizika, která odpovídá obecnému úrokovému riziku.
1611	Deriváty (obecné úrokové riziko) Vyplňuje se podle čl. 328 až 330 CRR.
1612	Ostatní aktiva a závazky (obecné úrokové riziko) Vyplňuje se podle čl. 105 (2) až (13) CRR. Vykazují se ostatní aktiva a závazky mimo derivátů v tržní hodnotě.
162	Specifické úrokové riziko Vyplňuje se podle čl. 362 CRR. Vykazuje se ta část pozičního rizika, která odpovídá specifickému úrokovému riziku.
2	Měnové riziko Vyplňuje se podle čl. 363 (1) a 367 (2) CRR.
21	Deriváty (měnové riziko) Vyplňuje se podle čl. 328 až 330 CRR.
22	Ostatní aktiva a závazky (měnové riziko) Vyplňuje se podle čl. 105 (2) až (13) CRR. Vykazují se ostatní aktiva a závazky kromě derivátů v tržní hodnotě.
23	Podrozvahové položky (měnové riziko) Vyplňuje se podle přílohy č. 1 CRR. Vykazují se pozice v podrozvahových položkách obsažených v Příloze I CRR. Nezahrnují se repa a podobné transakce, transakce s delší dobou vypořádání a křížové započtení.

Kód	Název položky
6	Akciové riziko Vyplňuje se podle čl. 363 (1) CRR. Vykazuje se ta část pozičního rizika, která odpovídá rizikovým faktorům akciového rizika specifikovaným v čl. 367 (2) CRR.
61	Obecné akciové riziko Vyplňuje se podle čl. 362 CRR. Vykazuje se ta část pozičního rizika, která odpovídá obecnému akciovému riziku.
611	Deriváty (obecné akciové riziko) Vyplňuje se podle čl. 328 až 330 CRR.
612	Ostatní aktiva a závazky (obecné akciové riziko) Vyplňuje se podle čl. 105 (2) až (13). Vykazují se ostatní aktiva a závazky kromě derivátů v tržní hodnotě.
62	Specifické akciové riziko Vyplňuje se podle čl. 362 CRR. Vykazuje se ta část pozičního rizika, která odpovídá obecnému akciovému riziku.
71	Obecné riziko celkem Vykazuje se ta část tržního rizika, které je způsobeno tržními změnami týkajícími se obchodovatelných dluhových nástrojů, kapitálových nástrojů, měn a komodit. Počítá se VaR pro obecné riziko všech rizikových faktorů (po zápočtu vlivu korelace, je-li relevantní).
72	Specifické riziko celkem Vykazuje se část tržního rizika, která je způsobena specifickým úrokovým a akciovým rizikem. Počítá se VaR pro specifické riziko obchodovatelných dluhových nástrojů a kapitálových nástrojů.
8	Jiné riziko
80	Tržní riziko
S_CPOZICE	Pozice pro tržní rizika celkem Vyplňuje se podle čl. 363 (1) CRR v souladu s čl. 367 (2) CRR. Vykazuje se souhrn relevantních ukazatelů za jednotlivé typy rizik, tj. poziční, měnové a komoditní podle čl. 363 (1) CRR ve vazbě na rizikové faktory specifikované v čl. 367 (2) CRR.