

POPIS INFORMAČNÍCH PRVKŮ DATOVÉ OBLASTI V DATOVÉM SOUBORU**Kód DS:** COSIFE50**Akronym DS:** COS (ČNB) 50-04**Název DS:** Tržní riziko**Kód DO:** COS50_11**Název DO:** Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA**Kód IP:** MKR0001**Akronym IP:****Název IP:** Obchodovatelné dluhové nástroje v obchodním portfoliu**Charakteristika:**

Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (b) CRR.

Vykazují se všechny pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích zařazených do obchodního portfolia, pro které se vypočítávají kapitálové požadavky k pozičnímu riziku, podle čl. 92 (3) (b) CRR a podle části třetí hlavy III kapitoly 2 CRR (vykazují ve vazbě na kategorie, splatnost a použitý přístup propočtu).

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

Vazba na účetnictví:**Datový typ:** Number - Číslo**Parametry informačního prvku:**

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:**Algoritmus odvození:****Poznámka:**

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

Kód IP: MKR0002**Akronym IP:****Název IP:** Obecné riziko**Charakteristika:**

Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (b), čl. 339 a 340 CRR.

Vykazují se všechny pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku podle části třetí hlavy III kapitoly 2 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 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:**Algoritmus odvození:****Poznámka:**

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0003

Akronym IP:

Název IP: Deriváty

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 328 až 331 CRR.

Vykazují se všechny pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích ve formě derivátů v ocenění podle čl. 328 až 331 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 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0004

Akronym IP:

Název IP: Ostatní aktiva a závazky

Charakteristika:

Vykazují se všechny pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích jiných než deriváty v tržní hodnotě.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_001

Akronym IP:

Název IP: Zóna 1

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR zařazené do zóny 1.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(10) P0604(S_DO1RZ1)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_002

Akronym IP:

Název IP: Zóna 1 / do 1 měsíce včetně

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9)

CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) do jednoho měsíce včetně.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(10) P0604(01)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_006

Akronym IP:

Název IP: Zóna 2

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, zařazené do zóny 2.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(20) P0604(S_1AZ4K3Z2)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_007

Akronym IP:

Název IP: Zóna 2 / 1 až 2 roky včetně (1 až 1,9 roku včetně pro kupon

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9)

CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od jednoho do dvou let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od jednoho do 1,9 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(20) P0604(10)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_008

Akronym IP:

Název IP: Zóna 2 / 2 až 3 roky včetně (1,9 až 2,8 roku včetně pro kupo

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od dvou do tří let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 1,9 do 2,8 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(20) P0604(12)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_009

Akronym IP:

Název IP: Zóna 2 / 3 až 4 roky včetně (2,8 až 3,6 roku včetně pro kupo

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od tří do čtyř let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 2,8 do 3,6 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(20) P0604(14)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_003

Akronym IP:

Název IP: Zóna 1 / 1 až 3 měsíce včetně

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) od jednoho měsíce do tří měsíců včetně.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(10) P0604(03)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_004

Akronym IP:

Název IP: Zóna 1 / 3 až 6 měsíců včetně

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) od tří do šesti měsíců včetně.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(10) P0604(05)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_005

Akronym IP:

Název IP: Zóna 1 / 6 až 12 měsíců včetně

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) od šesti do dvanácti měsíců včetně.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(10) P0604(07)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_010

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, zařazené do zóny 3.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(S_OD4LZ3)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_011

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 / 4 až 5 let včetně (3,6 až 4,3 roku včetně pro kupon

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9)

CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od čtyř do pěti let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 3,6 do 4,3 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(20)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_012

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 / 5 až 7 let včetně (4,3 až 5,7 roku včetně pro kupon

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9)

CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od pěti do sedmi let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 4,3 do 5,7 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(22)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_013

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 / 7 až 10 let včetně (5,7 až 7,3 roku včetně pro kupo

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9)

CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od sedmi do deseti let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 5,7 do 7,3 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(24)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_014

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 / 10 až 15 let včetně (7,3 až 9,3 roku včetně pro kup

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od deseti do patnácti let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 7,3 do 9,3 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(26)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_015

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 / 15 až 20 let včetně (9,3 až 10,6 roku včetně pro ku

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9)

CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od patnácti do dvaceti let včetně pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 9,3 do 10,6 roku pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(27)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_016

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 $\overline{7}$ nad 20 let (10,6 až 12,0 let včetně pro kupon pod 3

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR nad dvacet let pro cenné papíry s kuponem 3 % a vyšším, resp. od 10,6 do 12,0 let pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(28)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_017

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 / nad 20 let (12 až 20 let včetně pro kupon pod 3 %)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9)

CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR od dvanácti do dvaceti let včetně pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zóna

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(30)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0006_018

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3 / nad 20 let (nad 20 let pro kupon pod 3 %)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou splatností podle čl. 339 (9) CRR, se zbytkovou splatností podle čl. 339 (2) CRR nad dvacet let včetně pro cenné papíry s kuponem nižším než 3 %.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0006 - Zona

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0604 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30) P0604(32)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0005

Akronym IP:

Název IP: Metoda splatností

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 339 (1) až (8) CRR.

Vykazují se všechny pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se kapitálový požadavek k obecnému riziku počítá metodou splatností podle čl. 339 (9) 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 P0602 P0603 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(S_ZONY)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0007_001

Akronym IP:

Název IP: Metoda durací

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 340 (1) až (7) CRR.

Vykazují se všechny pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích podle čl. 340 (1) až (6) CRR, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou durací podle čl. 340 (7) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0007 - Metoda durací

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(S_ZONY)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0008

Akronym IP:

Název IP: Specifické riziko

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (b) a čl. 335, 336 (1) až (3), 337 a 338 CRR. Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek ke specifickému riziku podle čl. 335, 336 (1) až (3), 337 a 338 CRR.

Zahrnují se neseuritizované dluhové nástroje (ř. 29, MKR0009), seuritizované nástroje (ř. 38, MKR0015) a nástroje v portfoliu obchodování s korelací (ř. 39, MKR0016). Zohledňuje se rovněž poslední věta čl. 327 (1) CRR.

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 346 a 347 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 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0009

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek pro neseuritizované dluhové nástroje

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 336 CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek ke specifickému riziku pro neseuritizované dluhové nástroje.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0010

Akronym IP:

Název IP: Dluhové CP 1. kategorie

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR.

Vykazují se pozice v dluhových cenných papírech v obchodním portfoliu, které by podle standardizovaného přístupu pro úvěrové riziko obdržely rizikovou váhu 0 % (1. kategorie v tabulce č. 1 v čl. 336 (1) CRR). Zahrnují se i pozice v úvěrových derivátech n-tého selhání bez externího ratingu.

Kapitálový požadavek k úvěrovým derivátům n-tého selhání bez externího ratingu se počítá jako součet hodnot referenčních nástrojů vážených příslušnými rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR s výjimkou n-1 nástrojů s nejnižším rizikovým koeficientem podle čl. 332 (1) (e), odst. 1 a 2 CRR - tzv. "look-through".

Podle čl. 336 (3) CRR mohou instituce vypočítat kapitálový požadavek ke specifickému riziku pro dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu v souladu s postupem podle čl. 129 (3) CRR (kryté dluhopisy), jako polovinu použitelného kapitálového požadavku ke specifickému riziku pro 2. kategorii v tabulce č. 1 v čl. 336 (1).

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 346 a 347 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 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0011_001

Akronym IP:

Název IP: Dluhové CP 2. kategorie

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR.

Vykazují se pozice v dluhových cenných papírech, které by podle standardizovaného přístupu pro úvěrové riziko obdržely 20 % nebo 50 % rizikovou váhu a ostatní kvalifikované položky vymezené v odstavci 4 (2. kategorie v tabulce č. 1 v čl. 336 (1) CRR). Zahrnují se i úvěrové deriváty n-tého selhání bez externího ratingu a dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu podle čl. 129 (3) CRR (kryté dluhopisy).

Kapitálový požadavek k úvěrovým derivátům n-tého selhání bez externího ratingu se počítá jako součet hodnot referenčních nástrojů vážených příslušnými rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR s výjimkou n-1 nástrojů s nejnižším rizikovým koeficientem podle čl. 332 (1) (e), odst. 1 a 2 CRR - tzv. "look-through".

Podle čl. 336 (3) CRR mohou instituce vypočítat kapitálový požadavek ke specifickému riziku pro dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu v souladu s postupem podle čl. 129 (3) CRR (kryté dluhopisy), jako polovinu použitelného kapitálového požadavku ke specifickému riziku pro 2. kategorii v tabulce č. 1 v čl. 336 (1).

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 346 a 347 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0011 - Dluhové CP dle 2. kategorie v Tab. 1 (čl. 325 (1) CRR)

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0062 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0062(95)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0011_002

Akronym IP:

Název IP: Dluhové CP 2. kategorie / do 6 měsíců včetně

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR.

Vykazují se pozice v dluhových cenných papírech zařazené do 2. kategorie podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) se zbytkovou splatností do 6 měsíců včetně. Zahrnují se i úvěrové deriváty n-tého selhání bez externího ratingu a dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu podle čl. 124 (3) CRR (kryté dluhopisy).

Kapitálový požadavek k úvěrovým derivátům n-tého selhání bez externího ratingu se počítá jako součet hodnot referenčních nástrojů vážených rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR s výjimkou n-1 nástrojů s nejnižším rizikovým koeficientem podle čl. 321 (1) písm. e), odst. 1 a 2 CRR - tzv. "look-through".

Podle čl. 325 (3) CRR mohou instituce vypočítat kapitálový požadavek ke specifickému riziku pro dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu v souladu s postupem podle čl. 124 (3) CRR (kryté dluhopisy), jako polovinu použitelného kapitálového požadavku ke specifickému riziku pro 2. kategorii v tabulce č. 1 v čl. 325 (1).

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 335 a 336 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0011 - Dluhové CP dle 2. kategorie v Tab. 1 (čl. 325 (1) CRR)

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0062 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0062(16)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0011_003

Akronym IP:

Název IP: Dluhové CP 2. kategorie / 6 měsíců až 24 měsíců včetně

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR.

Vykazují se pozice v dluhových cenných papírech zařazené do 2. kategorie podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR se zbytkovou splatností od 6 měsíců do 24 měsíců včetně. Zahrnují se i úvěrové deriváty n-tého selhání bez externího ratingu a dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu podle čl. 124 (3) CRR (kryté dluhopisy).

Kapitálový požadavek k úvěrovým derivátům n-tého selhání bez externího ratingu se počítá jako součet hodnot referenčních nástrojů vážených rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR s výjimkou n-1 nástrojů s nejnižším rizikovým koeficientem podle čl. 321 (1) písm. e) odst. 1 a 2 CRR - tzv. "look-through".

Podle čl. 325 (3) CRR mohou instituce vypočítat kapitálový požadavek ke specifickému riziku pro dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu v souladu s postupem podle čl. 124 (3) CRR (kryté dluhopisy), jako polovinu použitelného kapitálového požadavku ke specifickému riziku pro 2. kategorii v tabulce č. 1 v čl. 325 (1) CRR.

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 335 a 336 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0011 - Dluhové CP dle 2. kategorie v Tab. 1 (čl. 325 (1) CRR)

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0062 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0062(19)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0011_004

Akronym IP:

Název IP: Dluhové CP 2. kategorie / nad 24 měsíců

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR.

Vykazují se pozice v dluhových cenných papírech zařazené do 2. kategorie podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR se zbytkovou splatností nad 24 měsíců. Zahrnují se i úvěrové deriváty n-tého selhání bez externího ratingu a dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu podle čl. 124 (3) CRR (kryté dluhopisy).

Kapitálový požadavek k úvěrovým derivátům n-tého selhání bez externího ratingu se počítá jako součet hodnot referenčních nástrojů vážených rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 325 (1) CRR s výjimkou n-1 nástrojů s nejnižším rizikovým koeficientem podle čl. 321 (1) písm. e), odst. 1 a 2 CRR - tzv. "look-through".

Podle čl. 325 (3) CRR mohou instituce vypočítat kapitálový požadavek ke specifickému riziku pro dluhopisy, které splňují podmínky pro 10 % rizikovou váhu v souladu s postupem podle čl. 124 (3) CRR (kryté dluhopisy), jako polovinu použitelného kapitálového požadavku ke specifickému riziku pro 2. kategorii v tabulce č. 1 v čl. 325 (1) CRR.

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 335 a 336 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0011 - Dluhové CP dle 2. kategorie v Tab. 1 (čl. 325 (1) CRR)

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0062 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0062(20)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0012

Akronym IP:

Název IP: Dluhové CP 3. kategorie

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR.

Vykazují se pozice v dluhových cenných papírech, které by podle standardizovaného přístupu pro úvěrové riziko obdržely rizikovou váhu 100 % (3. kategorie v tabulce č. 1 v čl. 336 (1) CRR). Zahrnují se i úvěrové deriváty n-tého selhání bez externího ratingu.

Kapitálový požadavek k úvěrovým derivátům n-tého selhání bez externího ratingu se počítá jako součet hodnot referenčních nástrojů vážených rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR s výjimkou n-1 nástrojů s nejnižším rizikovým koeficientem podle čl. 332 (1) (e), odst. 1 a 2 CRR - tzv. "look-through".

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 346 a 347 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 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0013

Akronym IP:

Název IP: Dluhové CP 4. kategorie

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR.

Vykazují se pozice v dluhových cenných papírech, které by podle standardizovaného přístupu pro úvěrové riziko obdržely rizikovou váhu 150 % (4. kategorie v tabulce č. 1 v čl. 325 (1) CRR. Zahrnují se i úvěrové deriváty n-tého selhání bez externího ratingu.

Kapitálový požadavek k úvěrovým derivátům n-tého selhání bez externího ratingu se počítá jako součet hodnot referenčních nástrojů vážených rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 336 (1) CRR s výjimkou n-1 nástrojů s nejnižším rizikovým koeficientem podle čl. 332 (1) (e), odst. 1 a 2 CRR - tzv. "look-through".

Pokud je specifické riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 346 a 347 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 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0014

Akronym IP:

Název IP: Deriváty n-tého selhání s ratingem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 332 (1) (e) odst. 3 CRR.

Vykazují se pozice v úvěrových derivátech n-tého selhání s externím ratingem.

Nezahrnují se pozice v úvěrových derivátech n-tého selhání bez externího ratingu.

Pokud je obecné riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 346 a 347 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 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

Pokud je obecné riziko úrokových pozic zajištěno úvěrovým derivátem, postupuje se podle čl. 335 a 336 CRR.

Verze:1.0

Stav:Projektovaný

Platnost od:

Zdroj:

Garant: /

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0015

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek pro sekuritizované nástroje

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek ke specifickému riziku sekuritizovaných nástrojů, který je roven hodnotě MKR0079 Kapitálový požadavek celkem z datové oblasti COS50_21 Sekuritizace podle úlohy instituce. Pro tento kapitálový požadavek není požadováno třídění podle měn, proto je uveden pouze na celkové kartě.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0016

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k portfoliu obchodování s korelací

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 338 CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek k pozicím v portfoliu k obchodování s korelací, který je roven hodnotě MKR0079 Kapitálový požadavek celkem z datové oblasti COS50_31 a vyazuje se v dané datové oblasti pouze na součtové kartě.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0017

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k pozicím v subjektech kolektivního inv

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 348 až 350 CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek k pozicím v subjektech kolektivním investování (dále jen FKI), pokud nejsou kapitálové požadavky k těmto expozicím nebo podkladovým nástrojům počítány podle metod stanovených v části třetí hlavě IV kapitole 5 CRR (vlastní modely). Zahrnují se rovněž vlivy použitých "stropů" (horních limitů) kapitálových požadavků, kde je to relevantní.

Pokud se postupuje podle specifické metody dle čl. 348 první věty CRR, vykazuje se zde hodnota odpovídající 32 % čisté pozice relevantní pro expozice vůči FKI. Pokud se postupuje podle specifické metody dle čl. 348 druhé věty CRR, vykazuje se zde nižší z hodnot - 32 % čisté pozice relevantní pro expozice vůči subjektům kolektivního investování a rozdíl mezi 40 % čisté pozice a kapitálovým požadavkem souvisejícím s měnovým rizikem relevantním pro expozice vůči FKI.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0018

Akronym IP:

Název IP: Dodatečný kapitálový požadavek pro opce (jiná rizika než del

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta.

CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro opce pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0083

Akronym IP:

Název IP: Zjednodušená metoda

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím zjednodušené metody. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro opce pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0084

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko gamma

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko gamma. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro opce pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0085

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko vega

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko vega. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro opce pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0086

Akronym IP:

Název IP: Metoda analýzy situací

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody analýzy situací. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro opce pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0007_002

Akronym IP:

Název IP: Zóna 1

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 340 (4) CRR.

Vyazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou durací podle čl. 340 (7) CRR, zařazené do zóny 1.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0007 - Metoda durací

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(10)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0007_003

Akronym IP:

Název IP: Zóna 2

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 340 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou durací podle čl. 340 (7) CRR, zařazené do zóny 2.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0007 - Metoda durací

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(20)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_11

Název DO: Kapitálový požadavek k úrokovému riziku při STA

Kód IP: MKR0007_004

Akronym IP:

Název IP: Zóna 3

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 340 (4) CRR.

Vykazují se pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku metodou durací podle čl. 340 (7) CRR, zařazené do zóny 3.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0007 - Metoda durací

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0602 P0603 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0603(30)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_21
Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0065_001
Název IP: Celkové dlouhé pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR.
Vykazuje se hodnota sekuritizovaných dlouhých pozic podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR ve spojení s čl. 337 CRR (sekuritizované pozice). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(010)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_21
Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0065_002
Název IP: Celkové krátké pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR.
Vykazuje se hodnota sekuritizovaných krátkých pozic podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR v návaznosti na čl. 337 CRR (sekuritizované pozice). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328(2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(020)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_003

Akronym IP:

Název IP: (-) Pozice odečtené z vlast. kapitálu - dlouhé

Charakteristika:

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

Vyazuje se hodnota dlouhých sekuritizovaných pozic, které se odečítají od vlastního kapitálu v případě, kdy vykazující subjekt zvolil tento alternativního přístupu k sekuritizovaným pozicím s rizikovou váhou 1250 %. Položka snižuje hodnotu expozice, proto se vyazuje jako záporná hodnota (se znaménkem -).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(110)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_004

Akronym IP:

Název IP: (-) Pozice odečtené z vlast. kapitálu - krátké

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 258 CRR (přístup STA), resp. čl. 266 (3) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota krátkých sekuritizovaných pozic, které se odečítají od vlastního kapitálu v případě, kdy vykazující osoba zvolila tento alternativní způsob zacházení se sekuritizovanými pozicemi s rizikovou vahou 1250 %.

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

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(120)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_21
Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0065_045
Název IP: Čisté dlouhé pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 327 až 329 CRR a podle čl. 334 CRR.
Vykazuje se čistá hodnota dlouhých pozic. Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0065_046
Název IP: Čisté krátké pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 327 až 329 CRR a podle čl. 334 CRR.
Vykazuje se čistá hodnota krátkých pozic. Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_007

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 7-10%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 7 - 10 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(019) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_008

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 12 - 18%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 12 - 18 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(022) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_009

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 20 - 35%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 20 - 35 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(035) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_010

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 40 - 75%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 40 - 75 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. podle tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(059) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_011

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 100%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 100 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(070) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_012

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 150%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 150 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(080) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_013

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 200%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 316 až 318 CRR a podle čl. 323 CRR.

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic, na které je aplikována riziková váha ve výši 200 % podle tabulky č. 1 v čl. 246 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 256 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 317 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou váhou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(095) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_014

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 225%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 225 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(096) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_015

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 250%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(097) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_016

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 300%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB.)

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 300 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(104) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_017

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 350%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 350 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(108) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_018

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 425%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 425 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(111) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_019

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 500%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 500 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(112) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_020

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 650%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 650 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(113) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_021

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 750%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 750 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(114) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_022

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 850%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 850 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(115) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_024

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 1250% / S ratingem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které mají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(117) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_025

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 1250% / Bez ratingu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které nemají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(118) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0066

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Metoda regulatorního vzorce

Charakteristika:

Vyplňuje se podle 337 (2) CRR ve spojení s čl. 262 CRR.

Vykazuje se čistá hodnota dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které vykazující osoba aplikovala metodu regulatorního vzorce, která určuje kapitálové požadavky z charakteristik zajištění a smluvních podmínek tranší.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0067

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Metoda regulatorního vzorce / Průměrná

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 262 CRR.

Vykazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých dlouhých sekuritizovaných pozic, pro které byla použita metoda regulatorního vzorce. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých dlouhých sekuritizovaných pozic, na které byla použita metoda regulatorního vzorce (MKR0066).

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0068

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Look-through

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 253, 254 a 256 (5) CRR (přístup STA), resp. čl. 263 (2) a (3) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota odpovídající součtu všech čistých dlouhých pozic bez ratingu, u nichž byla riziková váha určena na základě podkladového portfolia expozic (průměrná riziková váha podkladového seskupení, nejvyšší riziková váha podkladového seskupení nebo koeficient koncentrace v případě přístupu STA, resp. nejvyšší riziková váha podkladového seskupení v případě přístupu IRB). V případech předčasného umoření se použijí čl. 265 (1) a čl. 256 (5) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0069

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Přístup interního hodnocení

Charakteristika:

Vyplňuje se podle 2. věty čl. 109 (1) CRR a čl. 259 (3) CRR.

Vykazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic, pro které je riziková váha stanovena prostřednictvím interního hodnocení (IAA). Přístup interního hodnocení se užívá pro stanovení kapitálových požadavků pro likviditní facility a úvěrové linky v rámci programů ABCP. Přístup interního hodnocení, založený na metodikách používaných uznávanými ratingovými agenturami a je použitelný pouze pro ABCP expozice, které mají v den vzniku přidělený interní rating odpovídající investičnímu stupni. ABCP (program obchodních cenných papírů zajištěných aktivy) je definován v čl. 242 (9) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0070

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Přístup interního hodnocení / Průměrná

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 109 (1) a 259 (3) CRR.

Vyazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých dlouhých pozic, u kterých je riziková váha stanovena metodou interního hodnocení. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých dlouhých pozic, na které byla uplatněna metoda interního hodnocení (MKR0069).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_026

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 7 - 10%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 7 - 10 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(019) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_027

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 12 - 18%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 12 - 18 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(022) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_028

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 20 - 35%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 20 - 35 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(035) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_029

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 40 - 75%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 40 - 75 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(059) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_030

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 100%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 100 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261(1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(070) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_031

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 150%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 150 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(080) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_032

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 200%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 200 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(095) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_033

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 225%

Charakteristika:

Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 225% Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Vykazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 225 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(096) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_034

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 250%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(097) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_035

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 300%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 300 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(104) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_036

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 350%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 350 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(108) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_037

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 425%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 425 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(111) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_038

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 500%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 500 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(112) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_039

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 650%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 650 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(113) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_040

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 750%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 750 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(114) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_041

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 850%

Charakteristika:

až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 850 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(115) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_043

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 1250% / S ratingem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které mají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(117) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0065_044

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 1250% / Bez ratingu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které nemají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(118) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_21
Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0071
Název IP: Čisté krátké pozice / Metoda regulatorního vzorce

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle 337 (2) CRR ve spojení s čl. 262 CRR.
Vykazuje se čistá hodnota krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které vykazující osoba aplikovala metodu regulatorního vzorce, která určuje kapitálové požadavky z charakteristik zajištění a smluvních podmínek tranší.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0072
Název IP: Čisté krátké pozice / Metoda regulatorního vzorce / Průměrná

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 262 CRR.
Vykazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých krátkých sekuritizovaných pozic, pro které byla použita metoda regulatorního vzorce. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých krátkých pozic, na které byla použita metoda regulatorního vzorce (MKR0071).

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0073

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Look-through

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 253, 254 a 2561 (5) CRR (přístup STA), resp. čl. 263 (2) a (3) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota odpovídající součtu všech čistých krátkých sekuritizovaných pozic bez ratingu, u nichž byla riziková váha určena na základě podkladového portfolia expozic (průměrná riziková váha podkladového seskupení, nejvyšší riziková váha podkladového seskupení nebo koeficient koncentrace v případě přístupu STA, resp. nejvyšší riziková váha podkladového seskupení v případě přístupu IRB). V případech předčasného umoření se použijí čl. 265 (1) a čl. 256 (5) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0074

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Přístup interního hodnocení

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 109 (1) a 259 (3) CRR.

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic, pro které je riziková váha stanovena prostřednictvím interního hodnocení (IAA). Přístup interního hodnocení se užívá pro stanovení kapitálových požadavků pro likviditní facility a úvěrové linky v rámci programů ABCP. Přístup interního hodnocení, který je založený na metodikách používaných uznávanými ratingovými agenturami a je použitelný pouze pro ABCP expozice, které mají v den vzniku přidělený interní rating odpovídající investičnímu stupni. ABCP (program obchodních cenných papírů zajištěných aktivy) je definován v čl. 242 (9) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0075

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Přístup interního hodnocení / Průměrná

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 109 (1) a 259 (3) CRR.

Vyazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých krátkých sekuritizovaných pozic, u kterých je riziková váha stanovena metodou interního hodnocení. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých krátkých pozic, na které byla uplatněna metoda interního hodnocení (MKR0074).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0076_001

Akronym IP:

Název IP: Úpravy z důvodu porušení ustanovení o náležité péči / Riziko

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 (3) CRR ve spojení s čl. 13 (2) a 407 CRR.
Vykazuje se hodnota úprav z důvodu porušení ustanovení o náležité péči v souladu s čl. 337 (3) CRR v návaznosti na čl. 407 CRR a čl. 13 (2) CRR vztahující se k dlouhým sekuritizovaným pozicím.
Položka snižuje hodnotu expozice, proto se vykazuje jako záporná hodnota (se znaménkem -).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0076 - Úpravy z důvodu omezení výkonu hloubkové kontroly

Parametry informačního prvku:

P0011 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0602(160)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0076_002

Akronym IP:

Název IP: Úpravy z důvodu porušení ustanovení o náležité péči / Riziko

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 (3) CRR ve spojení s čl. 13 (2) a 407 CRR.
Vykazuje se hodnota úprav z důvodu porušení ustanovení o náležité péči v souladu s čl. 337 (3) CRR v návaznosti na čl. 407 CRR a čl. 13 (2) CRR, vztahující se ke krátkým sekuritizovaným pozicím.
Položka snižuje hodnotu expozice, proto se vykazuje jako záporná hodnota (se znaménkem -).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0076 - Úpravy z důvodu omezení výkonu hloubkové kontroly

Parametry informačního prvku:

P0011 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0602(170)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0077_001

Akronym IP:

Název IP: Pozice před aplikací limitů / Rizikově vážené čisté pozice -

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR před aplikací limitu podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0077 - Pozice před aplikací limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(160)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0077_002

Akronym IP:

Název IP: Pozice před aplikací limitů / Rizikově vážené čisté pozice -

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) před aplikací limitu podle čl. 335 CRR, která vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0077 - Pozice před aplikací limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(170)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0077_003

Akronym IP:

Název IP: Pozice před aplikací limitů / Rizikově vážené čisté pozice -

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 326 CRR.

Vyazuje se hodnota součtu čistých dlouhých a krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) před aplikací limitu podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0077 - Pozice před aplikací limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(150)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0078_001

Akronym IP:

Název IP: Pozice po aplikaci limitů / Rizikově vážené čisté pozice - d

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic upravená příslušnými rizikovými vahami pozic podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0078 - Pozice po aplikaci limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(160)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0078_002

Akronym IP:

Název IP: Pozice po aplikaci limitů / Rizikově vážené čisté pozice - k

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 a čl. 335 CRR.

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0078 - Pozice po aplikaci limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(170)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_21

Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Kód IP: MKR0078_003

Akronym IP:

Název IP: Pozice po aplikaci limitů / Rizikově vážené čisté pozice - s

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 a čl. 335 CRR.

Vyazuje se hodnota součtu čistých dlouhých a krátkých pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0078 - Pozice po aplikaci limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(150)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_21
Název DO: Sekuritizace podle úlohy instituce

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0079
Název IP: Kapitálový požadavek celkem

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota kapitálového požadavku v souladu s čl. 337 (4) CRR, tj. po přechodné období končící 31. 12. 2014, vykazující osoba sčítá odděleně své rizikově vážené dlouhé pozice a rizikově vážené krátké pozice po aplikaci limitů (sl. 58 resp. 59). Vyšší z těchto součtů se vykáže jako kapitálový požadavek. Od roku 2015 podle čl. 337 (4) CRR vykazující osoba musí sčítat své rizikově vážené čisté pozice bez ohledu na to, zda jsou dlouhé nebo krátké (sl. 60), aby určila kapitálový požadavek.

V případě portfolia obchodování s korelací (CTP) je kapitálový požadavek vyšší z hodnot kapitálových požadavků ke specifickému riziku čistých dlouhých pozic po aplikaci limitů (MKR0078_001) nebo čistých krátkých pozic po aplikaci limitů (MKR0078_002).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_22

Název DO: Sekuritizované rizikově vážené expozice podle typu podkladov

Kód IP: MKR0080

Akronym IP:

Název IP: Rizikově vážené pozice před aplikací limitů

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 CRR.

Vyazuje se hodnota součtu čistých dlouhých a krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR před aplikací limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0610

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0081

Akronym IP:

Název IP: Rizikově vážené pozice po aplikaci limitů

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 a čl. 335 CRR.

Vyazuje se hodnota součtu čistých dlouhých a krátkých pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 326 CRR po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0610

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_001

Akronym IP:

Název IP: Celkové dlouhé pozice

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR.

Vyazuje se hodnota sekuritizovaných dlouhých pozic podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR ve spojení s čl. 337 CRR (sekuritizované pozice). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(010)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_002

Akronym IP:

Název IP: Celkové krátké pozice

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR.

Vyazuje se hodnota sekuritizovaných krátkých pozic podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR v návaznosti na čl. 337 CRR (sekuritizované pozice). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328(2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(020)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_003

Akronym IP:

Název IP: (-) Pozice odečtené z vlast. kapitálu - dlouhé

Charakteristika:

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

Vyazuje se hodnota dlouhých sekuritizovaných pozic, které se odečítají od vlastního kapitálu v případě, kdy vykazující subjekt zvolil tento alternativního přístupu k sekuritizovaným pozicím s rizikovou váhou 1250 %. Položka snižuje hodnotu expozice, proto se vykazuje jako záporná hodnota (se znaménkem -).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(110)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_004

Akronym IP:

Název IP: (-) Pozice odečtené z vlast. kapitálu - krátké

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 258 CRR (přístup STA), resp. čl. 266 (3) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota krátkých sekuritizovaných pozic, které se odečítají od vlastního kapitálu v případě, kdy vykazující osoba zvolila tento alternativní způsob zacházení se sekuritizovanými pozicemi s rizikovou vahou 1250 %.

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

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(120)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_045

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 327 až 329 CRR a podle čl. 334 CRR.

Vyazuje se čistá hodnota dlouhých pozic. Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0065_046

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 327 až 329 CRR a podle čl. 334 CRR.

Vyazuje se čistá hodnota krátkých pozic. Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_007

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 7-10%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 7 - 10 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(019) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_008

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 12 - 18%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 12 - 18 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(022) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_009

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 20 - 35%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 20 - 35 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(035) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_010

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 40 - 75%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 40 - 75 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. podle tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(059) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_011

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 100%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 100 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(070) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_015

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 250%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(097) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_017

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 350%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 350 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(108) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_018

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 425%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 425 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(111) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_020

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 650%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 650 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(113) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_023

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / Ostatní

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 CRR (přístup IRB). Vykazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 CRR, na které je aplikována riziková váha podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB), které nejsou uvedeny samostatně. Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Nezahrnují se sekuritizované pozice, na které je aplikovaná riziková váha 1250 %. Úvěrové deriváty n-tého selhání se zahrnují pouze v případě, že nemají externí rating. Úvěrové deriváty n-tého selhání s externím ratingem se vykazují buď v datové oblasti COS50_11 na ř. 37 nebo, jsou-li součástí portfolia obchodování s korelací (CTP), musí být vykázány v datové oblasti COS50_32 ve sloupci s relevantní rizikovou vahou. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(120) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_024

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 1250% / S ratingem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které mají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(117) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_025

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 1250% / Bez ratingu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které nemají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(118) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0066

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Metoda regulatorního vzorce

Charakteristika:

Vyplňuje se podle 337 (2) CRR ve spojení s čl. 262 CRR.

Vykazuje se čistá hodnota dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které vykazující osoba aplikovala metodu regulatorního vzorce, která určuje kapitálové požadavky z charakteristik zajištění a smluvních podmínek tranší.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0067

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Metoda regulatorního vzorce / Průměrná

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 262 CRR.

Vykazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých dlouhých sekuritizovaných pozic, pro které byla použita metoda regulatorního vzorce. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých dlouhých sekuritizovaných pozic, na které byla použita metoda regulatorního vzorce (MKR0066).

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0068

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Look-through

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 253, 254 a 256 (5) CRR (přístup STA), resp. čl. 263 (2) a (3) CRR (přístup IRB).

Vykazuje se hodnota odpovídající součtu všech čistých dlouhých pozic bez ratingu, u nichž byla riziková váha určena na základě podkladového portfolia expozic (průměrná riziková váha podkladového seskupení, nejvyšší riziková váha podkladového seskupení nebo koeficient koncentrace v případě přístupu STA, resp. nejvyšší riziková váha podkladového seskupení v případě přístupu IRB). V případech předčasného umoření se použijí čl. 265 (1) a čl. 256 (5) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0069

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Přístup interního hodnocení

Charakteristika:

Vyplňuje se podle 2. věty čl. 109 (1) CRR a čl. 259 (3) CRR.

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic, pro které je riziková váha stanovena prostřednictvím interního hodnocení (IAA). Přístup interního hodnocení se užívá pro stanovení kapitálových požadavků pro likviditní facility a úvěrové linky v rámci programů ABCP. Přístup interního hodnocení, založený na metodikách používaných uznávanými ratingovými agenturami a je použitelný pouze pro ABCP expozice, které mají v den vzniku přidělený interní rating odpovídající investičnímu stupni. ABCP (program obchodních cenných papírů zajištěných aktivy) je definován v čl. 242 (9) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0070

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Přístup interního hodnocení / Průměrná

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 109 (1) a 259 (3) CRR.

Vykazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých dlouhých pozic, u kterých je riziková váha stanovena metodou interního hodnocení. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých dlouhých pozic, na které byla uplatněna metoda interního hodnocení (MKR0069).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_026

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 7 - 10%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 7 - 10 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(019) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_027

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 12 - 18%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 12 - 18 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(022) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_028

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 20 - 35%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 20 - 35 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(035) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_029

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 40 - 75%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 40 - 75 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(059) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_030

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 100%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 100 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261(1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(070) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_034

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 250%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(097) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_036

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 350%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 350 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(108) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_037

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 425%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 425 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(111) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_039

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 650%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 650 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(113) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_042

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / Ostatní

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 CRR (přístup IRB). Vykazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 CRR, na které je aplikována riziková váha podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB), které nejsou uvedeny samostatně. Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Nezahrnují se sekuritizované pozice, na které je aplikovaná riziková váha 1250 %. Úvěrové deriváty n-tého selhání se zahrnují pouze v případě, že nemají externí rating. Úvěrové deriváty n-tého selhání s externím ratingem se vykazují buď v datové oblasti COS50_11 na ř. 37 nebo, jsou-li součástí portfolia obchodování s korelací, musí být vykázány v datové oblasti COS50_32 ve sloupci s relevantní rizikovou vahou. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(120) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_043

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 1250% / S ratingem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které mají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(117) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0065_044

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 1250% / Bez ratingu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které nemají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(118) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0071

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Metoda regulatorního vzorce

Charakteristika:

Vyplňuje se podle 337 (2) CRR ve spojení s čl. 262 CRR.

Vyazuje se čistá hodnota krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které vykazující osoba aplikovala metodu regulatorního vzorce, která určuje kapitálové požadavky z charakteristik zajištění a smluvních podmínek tranší.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0072

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Metoda regulatorního vzorce / Průměrná

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 262 CRR.

Vyazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých krátkých sekuritizovaných pozic, pro které byla použita metoda regulatorního vzorce. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých krátkých pozic, na které byla použita metoda regulatorního vzorce (MKR0071).

Hodnota v %.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0073

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Look-through

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 253, 254 a 2561 (5) CRR (přístup STA), resp. čl. 263 (2) a (3) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota odpovídající součtu všech čistých krátkých sekuritizovaných pozic bez ratingu, u nichž byla riziková váha určena na základě podkladového portfolia expozic (průměrná riziková váha podkladového seskupení, nejvyšší riziková váha podkladového seskupení nebo koeficient koncentrace v případě přístupu STA, resp. nejvyšší riziková váha podkladového seskupení v případě přístupu IRB). V případech předčasného umoření se použijí čl. 265 (1) a čl. 256 (5) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0074

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Přístup interního hodnocení

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 109 (1) a 259 (3) CRR.

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic, pro které je riziková váha stanovena prostřednictvím interního hodnocení (IAA). Přístup interního hodnocení se užívá pro stanovení kapitálových požadavků pro likviditní facility a úvěrové linky v rámci programů ABCP. Přístup interního hodnocení, který je založený na metodikách používaných uznávanými ratingovými agenturami a je použitelný pouze pro ABCP expozice, které mají v den vzniku přidělený interní rating odpovídající investičnímu stupni. ABCP (program obchodních cenných papírů zajištěných aktivy) je definován v čl. 242 (9) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0075

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Přístup interního hodnocení / Průměrná

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 109 (1) a 259 (3) CRR.

Vyazuje se vážená hodnota průměrné rizikové váhy čistých krátkých sekuritizovaných pozic, u kterých je riziková váha stanovena metodou interního hodnocení. Pro váženou hodnotu se jako váhy použijí hodnoty čistých krátkých pozic, na které byla uplatněna metoda interního hodnocení (MKR0074).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0077_001

Akronym IP:

Název IP: Pozice před aplikací limitů / Rizikově vážené čisté pozice -

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR před aplikací limitu podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0077 - Pozice před aplikací limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(160)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0077_002

Akronym IP:

Název IP: Pozice před aplikací limitů / Rizikově vážené čisté pozice -

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) před aplikací limitu podle čl. 335 CRR, která vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0077 - Pozice před aplikací limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(170)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0078_001

Akronym IP:

Název IP: Pozice po aplikaci limitů / Rizikově vážené čisté pozice - d

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic upravená příslušnými rizikovými vahami pozic podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0078 - Pozice po aplikaci limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(160)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0078_002

Akronym IP:

Název IP: Pozice po aplikaci limitů / Rizikově vážené čisté pozice - k

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 a čl. 335 CRR.

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0078 - Pozice po aplikaci limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(170)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_31

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku portfolia obchodování

Kód IP: MKR0079

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek celkem

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota kapitálového požadavku v souladu s čl. 337 (4) CRR, tj. po přechodné období končící 31. 12. 2014, vykazující osoba sčítá odděleně své rizikově vážené dlouhé pozice a rizikově vážené krátké pozice po aplikaci limitů (sl. 58 resp. 59). Vyšší z těchto součtů se vykáže jako kapitálový požadavek. Od roku 2015 podle čl. 337 (4) CRR vykazující osoba musí sčítat své rizikově vážené čisté pozice bez ohledu na to, zda jsou dlouhé nebo krátké (sl. 60), aby určila kapitálový požadavek.

V případě portfolia obchodování s korelací (CTP) je kapitálový požadavek vyšší z hodnot kapitálových požadavků ke specifickému riziku čistých dlouhých pozic po aplikaci limitů (MKR0078_001) nebo čistých krátkých pozic po aplikaci limitů (MKR0078_002).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_32
Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0065_001
Název IP: Celkové dlouhé pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR.
Vykazuje se hodnota sekuritizovaných dlouhých pozic podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR ve spojení s čl. 337 CRR (sekuritizované pozice). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(010)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_32
Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0065_002
Název IP: Celkové krátké pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR.
Vykazuje se hodnota sekuritizovaných krátkých pozic podle čl. 102 a čl. 105 (1) CRR v návaznosti na čl. 337 CRR (sekuritizované pozice). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328(2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(020)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_003

Akronym IP:

Název IP: (-) Pozice odečtené z vlast. kapitálu - dlouhé

Charakteristika:

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

Vyazuje se hodnota dlouhých sekuritizovaných pozic, které se odečítají od vlastního kapitálu v případě, kdy vykazující subjekt zvolil tento alternativního přístupu k sekuritizovaným pozicím s rizikovou váhou 1250 %. Položka snižuje hodnotu expozice, proto se vyazuje jako záporná hodnota (se znaménkem -).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(110)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_004

Akronym IP:

Název IP: (-) Pozice odečtené z vlast. kapitálu - krátké

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 258 CRR (přístup STA), resp. čl. 266 (3) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota krátkých sekuritizovaných pozic, které se odečítají od vlastního kapitálu v případě, kdy vykazující osoba zvolila tento alternativní způsob zacházení se sekuritizovanými pozicemi s rizikovou vahou 1250 %.

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

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(120)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_32
Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0065_045
Název IP: Čisté dlouhé pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 327 až 329 CRR a podle čl. 334 CRR.
Vykazuje se čistá hodnota dlouhých pozic. Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0065_046
Název IP: Čisté krátké pozice

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 327 až 329 CRR a podle čl. 334 CRR.
Vykazuje se čistá hodnota krátkých pozic. Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:
MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:
P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:
P0138(900) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_007

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 7-10%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 7 - 10 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(019) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_008

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 12 - 18%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 12 - 18 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(022) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_009

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 20 - 35%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 20 - 35 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR.

Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(035) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_010

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 40 - 75%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 40 - 75 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. podle tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(059) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_011

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 100%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 100 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(070) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_015

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 250%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(097) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_017

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 350%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 350 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(108) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_018

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 425%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 425 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(111) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_020

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 650%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 650 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(113) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_023

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / Ostatní

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 CRR (přístup IRB). Vykazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 CRR, na které je aplikována riziková váha podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB), které nejsou uvedeny samostatně. Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Nezahrnují se sekuritizované pozice, na které je aplikovaná riziková váha 1250 %. Úvěrové deriváty n-tého selhání se zahrnují pouze v případě, že nemají externí rating. Úvěrové deriváty n-tého selhání s externím ratingem se vykazují buď v datové oblasti COS50_11 na ř. 37 nebo, jsou-li součástí portfolia obchodování s korelací (CTP), musí být vykázány v datové oblasti COS50_32 ve sloupci s relevantní rizikovou vahou. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(120) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_024

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 1250% / S ratingem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které mají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(117) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_025

Akronym IP:

Název IP: Čisté dlouhé pozice / Rizikové váhy / 1250% / Bez ratingu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které nemají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. v tabulce č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice dlouhé pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(118) P0602(030)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_026

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 7 - 10%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 7 - 10 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(019) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_027

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 12 - 18%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 12 - 18 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(022) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_028

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 20 - 35%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 20 - 35 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(035) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_029

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 40 - 75%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha v rozpětí 40 - 75 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(059) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_030

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 100%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 100 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261(1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(070) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_034

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 250%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(097) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_036

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 350%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 350 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(108) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_037

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 425%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 425 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyzazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(111) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_039

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 650%

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, na které je aplikována riziková váha ve výši 650 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(113) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_042

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / Ostatní

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 CRR (přístup IRB). Vykazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 CRR, na které je aplikována riziková váha podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB), které nejsou uvedeny samostatně. Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Nezahrnují se sekuritizované pozice, na které je aplikovaná riziková váha 1250 %. Úvěrové deriváty n-tého selhání se zahrnují pouze v případě, že nemají externí rating. Úvěrové deriváty n-tého selhání s externím ratingem se vykazují buď v datové oblasti COS50_11 na ř. 37 nebo, jsou-li součástí portfolia obchodování s korelací, musí být vykázány v datové oblasti COS50_32 ve sloupci s relevantní rizikovou vahou. Vykazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(120) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_043

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 1250% / S ratingem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které mají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(117) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0065_044

Akronym IP:

Název IP: Čisté krátké pozice / Rizikové váhy / 1250% / Bez ratingu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 251 CRR (přístup STA) a podle čl. 261 (1) CRR (přístup IRB).

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic podle čl. 327 až 329 a 334 CRR, které nemají přiřazený rating a na které je aplikována riziková váha ve výši 1250 % podle tabulky č. 1 v čl. 251 CRR (přístup STA), resp. tabulky č. 4 v čl. 261 (1) CRR (přístup IRB). Definice krátké pozice je uvedena v čl. 328 (2) CRR. Vyazuje se hodnota pozice neupravená příslušnou rizikovou vahou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0065 - Pozice

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(118) P0602(040)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0077_001

Akronym IP:

Název IP: Pozice před aplikací limitů / Rizikově vážené čisté pozice -

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR před aplikací limitu podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0077 - Pozice před aplikací limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(160)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_32
Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Kód IP: MKR0077_002
Název IP: Pozice před aplikací limitů / Rizikově vážené čisté pozice -

Akronym IP:

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) před aplikací limitu podle čl. 335 CRR, která vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0077 - Pozice před aplikací limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(170)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0078_001

Akronym IP:

Název IP: Pozice po aplikaci limitů / Rizikově vážené čisté pozice - d

Charakteristika:

Vyazuje se hodnota čistých dlouhých sekuritizovaných pozic upravená příslušnými rizikovými vahami pozic podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0078 - Pozice po aplikaci limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(160)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_32

Název DO: Úvěrové deriváty n-tého selhání

Kód IP: MKR0078_002

Akronym IP:

Název IP: Pozice po aplikaci limitů / Rizikově vážené čisté pozice - k

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 a čl. 335 CRR.

Vyazuje se hodnota čistých krátkých sekuritizovaných pozic upravených příslušnými rizikovými vahami podle čl. 337 CRR resp. čl. 338 v případě portfolia obchodování s korelací (CTP) po aplikaci limitů podle čl. 335 CRR, který vykazující osobě umožňuje stanovit strop kapitálového požadavku k specifickému riziku čisté pozice v dluhovém nástroji ve výši maximální možné ztráty související s rizikem selhání.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Odvozen z primárního informačního prvku:

MKR0078 - Pozice po aplikaci limitů

Parametry informačního prvku:

P0011 P0138 P0602 P0609 P0611 P0613 P0628

Parametry konkretizované na informačním prvku:

P0138(900) P0602(170)

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0029

Akronym IP:

Název IP: Akcie v obchodním portfoliu

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (b) CRR a části třetí hlavy III kapitoly 2 a oddílu 3 CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek k obecnému a specifickému akciovému riziku k akciovým nástrojům v obchodním portfoliu.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0030

Akronym IP:

Název IP: Obecné riziko

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 343 CRR.

Vyazují se pozice v kapitálových nástrojích v obchodním portfoliu, ke kterým se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku podle části třetí hlavy III kapitoly 2 oddílu 3 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0031

Akronym IP:

Název IP: Deriváty

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 a 332 CRR.

Vykazují se všechny pozice v kapitálových nástrojích v obchodním portfoliu ve formě derivátů v ocenění podle čl. 329 až 332 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0032

Akronym IP:

Název IP: Ostatní aktiva a závazky

Charakteristika:

Vykazují se všechny pozice v obchodovatelných úrokových nástrojích jiných než deriváty v tržní hodnotě.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0033

Akronym IP:

Název IP: Futures na vhodně diversifikovaný akciový index (obchodovate

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 344 (1) a (4) CRR.

Vykazují se futures na vhodně diversifikovaný akciový index (obchodovatelné na burze), se kterými se zachází podle čl. 344 (1) a (4) CRR. Pro tyto pozice se počítá pouze kapitálový požadavek k obecnému riziku, proto se nezahrnují do výpočtu kapitálového požadavku ke specifickému riziku (ř. 7, MKR0035).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0034

Akronym IP:

Název IP: Akcie jiné než futures na vhodně diversifikovaný akciový ind

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 343 a 344 (3) CRR.

Vykazují se pozice v akciových nástrojích jiných než futures na vhodně diversifikovaný akciový index (obchodovatelné na burze), se kterými se zachází podle čl. 344 (3) CRR v obchodním portfoliu, pro které se počítá kapitálový požadavek k obecnému riziku podle čl. 343 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0035

Akronym IP:

Název IP: Specifické riziko

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 342 a 344 (4) CRR.

Vykazují se pozice v akciových nástrojích v obchodním portfoliu, pro které se počítá kapitálový požadavek ke specifickému riziku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0036

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k pozicím v subjektech kolektivního inv

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 337 až 339 CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek k pozicím v subjektech kolektivního investování, který se počítá podle čl. 348 (1) CRR, pokud nejsou kapitálové požadavky k těmto expozicím nebo podkladovým nástrojům počítány metodami stanovenými v části třetí hlavě IV kapitole 5 CRR (vlastní modely).

Pokud se postupuje podle specifické metody dle čl. 348 první věty CRR, vykazuje se zde hodnota odpovídající 32 % čisté pozice relevantní pro expozice vůči FKl. Pokud se postupuje podle specifické metody dle čl. 348 druhé věty CRR, vykazuje se zde nižší z hodnot - 32 % čisté pozice relevantní pro expozice vůči FKl a rozdíl mezi 40 % čisté pozice a kapitálovým požadavkem, souvisejícím s měnovým rizikem relevantním pro expozice vůči FKl.

Používá-li se specifická metoda podle čl. 350 CRR, pak vykazování těchto expozic se odvíjí od podkladových nástrojů. Následně budou tyto pozice vykazovány na relevantních řádcích jak v datové oblasti COS50_11 (úrokové riziko), tak v dané datové oblasti COS50_41 (akciové riziko).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0037

Akronym IP:

Název IP: Dodatečné požadavky pro opce (jiná rizika než delta)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0087

Akronym IP:

Název IP: Zjednodušená metoda

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím zjednodušené metody. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0088

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko gamma

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko gamma. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0089

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko vega

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko vega. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_41

Název DO: Kapitálový požadavek k akciovému riziku při STA

Kód IP: MKR0090

Akronym IP:

Název IP: Metoda analýzy situací

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody analýzy situací. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0025 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50 **Akronym DS:** COS (ČNB) 50-04
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_51
Název DO: Kapitálový požadavek k měnovému riziku při STA

Kód IP: MKR0038 **Akronym IP:**
Název IP: Pozice v cizích měnách celkem (bez CZK)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (c) (i) CRR.
Vykazují se všechny pozice v měnách, pro které se počítá kapitálový požadavek k měnovému riziku podle čl. 351 CRR. Při konverzi do Kč se postupuje podle čl. 352 (2) a (4) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0039 **Akronym IP:**
Název IP: Silně korelované měny

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 354 CRR.
Vykazují se pozice, pro které se počítá kapitálový požadavek k měnovému riziku, v silně korelovaných měnách.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:
P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_51

Název DO: Kapitálový požadavek k měnovému riziku při STA

Kód IP: MKR0040

Akronym IP:

Název IP: Ostatní měny celkem (vč. subjektů kolektivního investování,

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 351 a 352 (2) a (4) CRR.

Vykazují se pozice, pro které se počítají kapitálové požadavky k měnovému riziku, v měnách, u nichž se uplatňuje obecný postup podle čl. 351 a 352 (2) a (4) CRR. Zahrnují se i cizoměnové pozice v subjektech kolektivního investování, se kterými se zachází podle čl. 353 CRR.

S pozicemi vůči subjektům kolektivního investování se zachází jako se separátními měnami podle čl. 353 CRR. Pozice v subjektech kolektivního investování, s kterými se zachází jako se separátními měnami, se počítají dvěma způsoby:

1) modifikovaná metoda zacházení s investicemi ve zlatě se použije, pokud směr investic subjektu kolektivního investování není znám (pozice v subjektu kolektivního investování se přidá k celkové čisté měnové pozici vykazujícího subjektu),

2) pokud směr investic subjektu kolektivního investování je znám, pak pozice v subjektu kolektivního investování se přičte k celkové otevřené měnové pozici (dlouhé nebo krátké, podle směru pozice v subjektu kolektivního investování). Stejným způsobem se přistupuje k propočtu kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_51

Název DO: Kapitálový požadavek k měnovému riziku při STA

Kód IP: MKR0041

Akronym IP:

Název IP: Zlato

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 351 a 352 (2) a (4) CRR.

Vykazují se pozice ve zlatě, pro které se počítá kapitálový požadavek k měnovému riziku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0042

Akronym IP:

Název IP: Dodatečný kapitálový požadavek pro opce (jiná rizika než del

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 352 (5) a (6) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek k měnovému riziku pro opce pokrývající jiná rizika než delta. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_51

Název DO: Kapitálový požadavek k měnovému riziku při STA

Kód IP: MKR0091

Akronym IP:

Název IP: Zjednodušená metoda

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím zjednodušené metody. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0092

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko gamma

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko gamma. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_51

Název DO: Kapitálový požadavek k měnovému riziku při STA

Kód IP: MKR0093

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko vega

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko vega. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0094

Akronym IP:

Název IP: Metoda analýzy situací

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody analýzy situací. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_51

Název DO: Kapitálový požadavek k měnovému riziku při STA

Kód IP: MKR0043

Akronym IP:

Název IP: Ostatní aktiva a závazky (vč. CZK) - jiné než podrozvaha a d

Charakteristika:

Vykazují se pozice ve finančních nástrojích v tržní hodnotě, nazahrnutých do podrozvahových pozic (ř. 11) a derivátů (ř. 12)

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0044

Akronym IP:

Název IP: Pozice celkem (vč. CZK) - podrozvaha

Charakteristika:

Vyplňuje se podle přílohy č. 1 CRR.

Vykazují se pozice v podrozvahových položkách s výjimkou SFT nebo křížového započtení.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_51

Název DO: Kapitálový požadavek k měnovému riziku při STA

Kód IP: MKR0045

Akronym IP:

Název IP: Pozice celkem (vč. CZK) - deriváty

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 352 CRR.

Vykazují se pozice ve formě derivátů v ocenění podle čl. 352 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_52

Název DO: Měnové riziko při STA - pozice v jednotlivých měnách

Kód IP: MKR0064

Akronym IP:

Název IP: Pozice v jednotlivých měnách

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (c) (i) CRR.

Vykazují se všechny pozice, pro které se počítá kapitálový požadavek k měnovému riziku podle čl. 351 CRR. Při konverzi do Kč se postupuje podle čl. 352 (2) a (4) CRR.

Vyplňují se data jednotlivě za všechny měny členských zemí EU a dále za USD, CHF, JPY, RUB, TRY, AUD, CAD, RSD, ALL, UAH, MKD, EGP, ARS, BRL, MXN, HKD, ICK, TWD, NZD, NOK, SGD, KRW, CNY a ostatní měny (v jedné položce).

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0009 P0011 P0014 P0019 P0409 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_61

Název DO: Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku při STA

Kód IP: MKR0019

Akronym IP:

Název IP: Pozice v komoditách celkem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 92 (3) (c) (iii) CRR.

Vykazují se pozice v komoditách, ke kterým se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku podle části třetí hlavy IV kapitoly 4 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0020

Akronym IP:

Název IP: Drahé kovy (kromě zlata)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 361 CRR.

Vykazují se pozice v drahých kovech s výjimkou zlata, ke kterým se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku podle části třetí hlavy IV kapitoly 4 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_61

Název DO: Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku při STA

Kód IP: MKR0021

Akronym IP:

Název IP: Základní kovy

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 361 CRR.

Vykazují se pozice v základních kovech, ke kterým se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku podle části třetí hlavy IV kapitoly 4 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0022

Akronym IP:

Název IP: Zemědělské produkty (netrvanlivé)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 361 CRR.

Vykazují se pozice v netrvanlivých zemědělských produktech, ke kterým se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku podle části třetí hlavy IV kapitoly 4 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_61

Název DO: Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku při STA

Kód IP: MKR0023

Akronym IP:

Název IP: Ostatní komodity

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 361 CRR.

Vykazují se pozice v ostatních komoditách včetně energetických produktů, ke kterým se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku podle části třetí hlavy IV kapitoly 4 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0024

Akronym IP:

Název IP: Ostatní komodity / z toho: energetické produkty

Charakteristika:

Vyplňuje se podle tabulky č. 2 v čl. 361 CRR.

Vykazují se pozice v energetických produktech (ropa, plyn aj.), ke kterým se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku podle části třetí hlavy IV kapitoly 4 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_61

Název DO: Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku při STA

Kód IP: MKR0025

Akronym IP:

Název IP: Metoda splatností

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 359 CRR.

Vykazují se pozice v komoditách, pro které se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku metodou splatností.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0026

Akronym IP:

Název IP: Rozšířena metoda splatnosti

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 361 CRR.

Vykazují se pozice v komoditách, pro které se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku rozšířenou metodou splatností.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_61

Název DO: Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku při STA

Kód IP: MKR0027

Akronym IP:

Název IP: Zjednodušená metoda: pozice celkem

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 360 CRR.

Vykazují se pozice v komoditách, pro které se počítá kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku zjednodušenou metodou.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0028

Akronym IP:

Název IP: Dodatečný kapitálový požadavek pro opce (jiná rizika než del

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 358 (4) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku pro opce pokrývající jiná rizika než delta. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku a riziková expozice celkem.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_61

Název DO: Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku při STA

Kód IP: MKR0095

Akronym IP:

Název IP: Zjednodušená metoda

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím zjednodušené metody. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0096

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko gamma

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko gamma. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vyazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_61

Název DO: Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku při STA

Kód IP: MKR0097

Akronym IP:

Název IP: Metoda delta plus - dodatečné požadavky pro riziko vega

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody delta plus pro riziko vega. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0098

Akronym IP:

Název IP: Metoda analýzy situací

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 329 (3) CRR.

Vykazuje se kapitálový požadavek pro opce pokrývající jiná rizika než delta - s použitím metody analýzy situací. CRR nestanovuje postup propočtu kapitálového požadavku pro jiná rizika než delta, proto se vykazuje pouze výsledná hodnota kapitálového požadavku.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0014 P0019 P0602 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0048

Akronym IP:

Název IP: VaR / Multiplikační faktor (mc) x průměr z předcházejících 6

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (1) (a) (ii) a čl. 365 (1) CRR.

Vykazuje se výsledek násobení multiplikačního faktoru (mc) a průměru VaR z předcházejících 60 pracovních dnů (VaRavg). VaR je maximální možná ztráta v důsledku změny cen při dané pravděpodobnosti v průběhu sledovaného období.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0049

Akronym IP:

Název IP: VaR v předcházející den (VaRt-1)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (1) (a) (i) a 365 (1).

Uvádí se hodnota VaR z předcházejícího dne.

VaR je maximální možná ztráta v důsledku změny cen při dané pravděpodobnosti v průběhu sledovaného období.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0050

Akronym IP:

Název IP: Stresová hodnota VaR / Multiplikační faktor (mc) x průměr z

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (1) (b) (ii) a čl. 365 (1) CRR.

Vyazuje se výsledek násobení multiplikačního faktoru (mc) a průměru

stresových hodnot VaR z předcházejících 60 pracovních dnů (SVaRavg).

Stresová hodnota VaR je maximální možná ztráta v důsledku změny cen při dané pravděpodobnosti ve sledovaném období po promítnutí vstupu kalibrovaného podle historických údajů ze souvislého 12-měsíčního období finančního stresu relevantního pro portfolio vykazujícího subjektu.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0051

Akronym IP:

Název IP: Stresová hodnota VaR / Poslední dostupná hodnota (SVaRt-1)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (1) (b) (i) a čl. 365 (1)

Uvádí se poslední dostupná hodnota (SVaRt-1).

Stresová hodnota VaR je maximální možná ztráta v důsledku změny cen při dané

pravděpodobnosti v průběhu sledovaného období po promítnutí vstupu

kalibrovaného podle historických údajů ze souvislého 12-měsíčního období

finančního stresu relevantního pro portfolio vykazujícího subjektu.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0052

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k dodatečnému riziku selhání a migrace

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (2) (b) (ii) CRR a části třetí hlavy IV kapitoly 5 oddílu 4 CRR.

Vykazuje se průměrný kapitálový požadavek k dodatečnému riziku selhání a migrace vypočítaný jako průměr z hodnot rizika dodatečného selhání a migrace za období předchozích 12 týdnů.

Pro účely stanovení kapitálového požadavku k dodatečnému riziku selhání a migrace se jedná o maximální možnou ztrátu v důsledku změny cen na základě události selhání a migrace.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0053

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k dodatečnému riziku selhání a migrace

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (2) (b) (i) CRR a části třetí hlavy IV kapitoly 5 oddílu 4 CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek k dodatečnému riziku selhání a migrace vypočtený z nejnovější hodnoty dodatečného rizika selhání a migrace.

Pro účely stanovení kapitálového požadavku k dodatečnému riziku selhání a migrace se jedná o maximální možnou ztrátu v důsledku změny cen na základě události selhání a migrace.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0054

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k cenovému riziku celkem pro portfolio

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (3) (c) CRR.

Vyazuje se hodnota, která se rovná 8 % ze všech pozic zahrnutých do portfolia obchodování s korelací podle čl. 338 (1) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0055

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k cenovému riziku celkem pro portfolio

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (3) (b) CRR.

Vyazuje se průměrný kapitálový požadavek k portfoliu obchodování s korelací vypočítaný jako prostý průměr hodnot kapitálového požadavku k portfoliu obchodování s korelací za období posledních 12 týdnů před datem vykazování.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0056

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek k cenovému riziku celkem pro portfolio

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (3) (a) CRR.

Vyazuje se kapitálový požadavek k portfoliu k obchodování s korelací vypočtený v den vykazování nebo v den nejbližší předcházejícímu datu vykazování.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0057

Akronym IP:

Název IP: Kapitálový požadavek

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 CRR.

Vykazuje se celkový kapitálový požadavek za všechna rizika se zohledněním vlivu korelace, je-li relevantní, dodatečného rizika selhání a migrace, rizika pro portfolio obchodování s korelací. Nezahrnuje se kapitálový požadavek k sekuritizaci a k úvěrovým derivátům n-tého selhání podle čl. 364 (2) CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0058

Akronym IP:

Název IP: Rizikové expozice celkem

Charakteristika:

Postupuje se podle čl. 92 (4) (b) CRR.

Vykazuje se výsledná hodnota po vynásobení hodnoty kapitálového požadavku (MKR0057) koeficientem 12,5.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0059

Akronym IP:

Název IP: Počet překročení VaR během předcházejících 250 pracovních dn

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 366 CRR.

Vyazuje se počet překročení denních hodnot v riziku (VaR), ke kterým došlo v průběhu 250 pracovních dnů bezprostředně předcházejícího dne vykazování.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0060

Akronym IP:

Název IP: VaR multiplikační faktor (mc)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 366 CRR.

Vyazuje se hodnota multiplikačního faktoru podle čl. 366 CRR, používaného pro zvýšení hodnoty VaR vypočtené podle čl. 365 CRR..

Číselná hodnota.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50 **Akronym DS:** COS (ČNB) 50-04
Název DS: Tržní riziko
Kód DO: COS50_71
Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních
Kód IP: MKR0061 **Akronym IP:**
Název IP: SVaR multiplikační faktor (mc)

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 366 CRR.

Vyplňuje se hodnota multiplikačního faktoru podle čl. 366 CRR, používaného pro zvýšení hodnoty stresového VaR vypočtené podle čl. 365 CRR.

Číselná hodnota.

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód IP: MKR0062 **Akronym IP:**
Název IP: Předpokládaný spodní limit kapitálového požadavku pro portfo

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (3) (c) CRR.

Vyazuje se hodnota čisté dlouhé pozice vážená příslušnými rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 336 CRR v portfoliu obchodování s korelací se zohledněním diskrece, která umožňuje vykazujícím subjektům stanovit limit pro kapitálový požadavek ke specifickému riziku podle čl. 335 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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

Kód DS: COSIFE50

Akronym DS: COS (ČNB) 50-04

Název DS: Tržní riziko

Kód DO: COS50_71

Název DO: Kapitálový požadavek k tržnímu riziku při použití vlastních

Kód IP: MKR0063

Akronym IP:

Název IP: Předpokládaný spodní limit kapitálového požadavku pro portfo

Charakteristika:

Vyplňuje se podle čl. 364 (3) (c) CRR.

Vykazuje se hodnota čisté krátké pozice vážená příslušnými rizikovými vahami podle tabulky č. 1 v čl. 336 CRR v portfoliu k obchodování s korelací se zohledněním diskrece, která umožňuje vykazujícím subjektům stanovit limit pro kapitálový požadavek ke specifickému riziku podle čl. 335 CRR.

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

Vazba na účetnictví:

Datový typ: Number - Číslo

Parametry informačního prvku:

P0011 P0013 P0019 P0409 P0611

Parametry konkretizované na informačním prvku:

Algoritmus odvození:

Poznámka:

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