

Kód: LIKIFE20

Akronym: LIK (ČNB) 20-04

Název: Stabilní financování na konsolidovaném základě

Charakteristika:

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

Hlášení se skládá ze 2 částí:

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

Část 1. zahrnuje přehled aktiv vyžadujících stabilní financování v členění (dle čl. 428 (2) CRR) podle data jejich splatnosti nebo nejbližšího data kdy mohou být smluvně splaceny a rovněž podle stupně likviditní a úvěrové kvality aktiv.

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

Všechny položky se vykazují souhrnně v CZK bez ohledu na jejich skutečnou denominaci podle č. 415 (1) CRR a dále v jednotlivých jiných měnách než je měna vykazovací (tj. jiných než CZK), pokud jsou splněny podmínky čl. 415 (2) CRR (vždy v přepočtu na CZK).

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

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

Hlášení vyplňují pouze mateřské instituce v EU, instituce kontrolované mateřskou FHS v EU a instituce kontrolované mateřskou smíšenou FHS v EU.

Části datového souboru:

Část: 1 - Aktiva vyžadující stabilní financování

Přiřazené datové oblasti:

Pořadí	Kód	Název
1	LIK20_11	Aktiva vyžadující stabilní financování - část 1
2	LIK20_12	Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky

Část: 2 - Položky zajišťující stabilní financování

Přiřazené datové oblasti:

Pořadí	Kód	Název
1	LIK20_21	Položky zajišťující stabilní financování

Kód: LIKIFE20

Akronym: LIK (ČNB) 20-04

Název: Stabilní financování na konsolidovaném základě

Vykaz.povinnost: VP_LIKIFE20_1

Název : Vykazovací povinnost pro COKIFE20_bankyK

Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0002	Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt	E	ZKC2_BANKY	Celky pro obezřetnostní konsolidaci - 2
P0046	Rozsah vykazování podle území	E	ZSVET	Údaje za Českou republiku a zahraničí
P0053	Stav ke dni	E	d1_I1	Datum ve tvaru YYYYMMDD z přípustného intervalu

Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0012	Periodicita	=	S_Q_NV	Čtvrtletně, jinak na vyžádání
P0060	Termín předkládání	E	ZQ_91	k 31.3. do 30.6., násl. Q do 11.8., 11.11. a 11.2., na vyž.

Vykaz.povinnost: VP_LIKIFE20_2

Název : Vykazovací povinnost pro LIKIFE20_DZK

Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0002	Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt	E	Z_KC1_DZ	Celky pro obezřetnostní konsolidaci - DZ
P0046	Rozsah vykazování podle území	E	ZSVET	Údaje za Českou republiku a zahraničí
P0053	Stav ke dni	E	d1_I1	Datum ve tvaru YYYYMMDD z přípustného intervalu

Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0012	Periodicita	=	S_Q_NV	Čtvrtletně, jinak na vyžádání
P0060	Termín předkládání	E	ZQ_91	k 31.3. do 30.6., násl. Q do 11.8., 11.11. a 11.2., na vyž.

Poznámka:

Verze:1.0	Stav:Platný	Platnost od:01.01.2014
Zdroj:		
Garant věcného obsahu :Žulavská, Pokorná/odb.563		
Garant metodického popisu:Žulavská, Pokorná/odb.563		