

**POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR****Datový soubor:** LISIFE20**Akronym:** LIS (ČNB) 20-04**Název:** Stabilní financování**Datová oblast:** LIS20\_11**Název:** Aktiva vyžadující stabilní financování - část 1**Charakteristika:**

Přehled části aktiv vyžadujících stabilní financování (zejména likvidní aktiva podle čl. 416 CRR, další cenné papíry a nástroje finančního trhu, majetkové cenné papíry nefinančních subjektu (hlavní index na regulovaných trzích) aj. Tato aktiva se uvádějí v pěti koších (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.

Pro opce realizovatelné na přání vykazující osoby, musí vykazující osoba brát v úvahu reputační faktory, které mohou omezit schopnost vykazující osoby opci realizovat. Zejména pokud třetí strana očekává, že opce nebude realizována, musí vykazující osoba počítat s tímto chováním pro účel vykazování aktiv v této datové oblasti.

Aktiva se vykazují podle zbytkové smluvní splatnosti, nikoliv podle očekávané skutečnosti.

S aktivy, které mají vazbu na zajištěné úvěrové transakce a transakce na kapitálovém trhu podle čl. 192 CRR se zachází následovně: 1) nezahrnují se aktiva půjčena (v rámci reverzních repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba nevlastní; 2) zahrnují se aktiva zapůjčena (v rámci repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba stále vlastní; 3) zahrnují se zatížené cenné papíry zapůjčené v rámci repo obchodů, která vykazující osoba stále vlastní a která stále eviduje ve své rozvaze; tyto zatížené cenné papíry se vykazují v relevantní kategorii pro stabilní financování.

Každá kategorie aktiv se ve vazbě na čl. 510 CRR vykazuje v členění podle zatížení: aktiva nezatížená a aktiva zatížená v rozpadu podle doby, po kterou jsou aktiva zatížena.

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 .

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0335	Likvidní aktiva podle čl. 416	
LCR0336	Hotovost	
LCR0337	Expozice vůči centrálním bankám	
LCR0338	Expozice vůči centrálním bankám pro krizovou situaci	

**Datový soubor:** LISIFE20

**Akronym:** LIS (ČNB) 20-04

**Datová oblast:** LIS20\_11

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0339	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo jimi zar
LCR0340	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou
LCR0341	Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou
LCR0342	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo
LCR0343	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru
LCR0344	Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt
LCR0345	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB nebo jimi zaručené
LCR0346	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB
LCR0347	Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB
LCR0348	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených nezatížené
LCR0349	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené do
LCR0350	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB zatížené od 3 měsíců do 6 m
LCR0351	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené od
LCR0352	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené od
LCR0353	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB vč. zaručených zatížené nad
LCR0354	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabili
LCR0355	Pohledávky za nástrojem fin. stability nebo mechanismem stab
LCR0356	Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s
LCR0357	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0358	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad. aktivy podle č
LCR0359	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad. aktivy podle čl
LCR0360	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad.aktivy podle čl.
LCR0361	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0362	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0363	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0364	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0365	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0366	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0367	Vklady a likvidní financování od ústřední úvěr. instituce ne
LCR0368	Vklady u ústřední úvěrové instituce
LCR0369	Likvidní financování od ústřední úvěr.instituce nebo členů s
LCR0370	Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou
LCR0371	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky
LCR0372	Ostatní nezatížená převoditelná aktiva představující pohledá
LCR0373	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatížen

**Datový typ údajů**

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0374	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatížen
LCR0375	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatížen
LCR0376	Ostatní převoditelná aktiva představující pohledávky zatíže
LCR0377	Ostatní převoditelná aktiva zatížená nad 12 měsíců představu
LCR0378	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků
LCR0379	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků nezatížené
LCR0380	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené do 3 měsí
LCR0381	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené od 3 do 6
LCR0382	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené od 6 do 9
LCR0383	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené od 9 do 1
LCR0384	Dluhové cenné papíry nefinančních podniků zatížené nad 12 mě
LCR0385	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI
LCR0386	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI nezatí
LCR0387	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0388	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0389	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0390	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0391	CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0392	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI
LCR0393	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI nezatí
LCR0394	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0395	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0396	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0397	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0398	CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI zatíže
LCR0399	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)
LCR0400	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) nezat
LCR0401	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží
LCR0402	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží
LCR0403	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží
LCR0404	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží
LCR0405	Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5) zatíží
LCR0406	Ostatní dluhové CP vydané ÚI
LCR0407	Ostatní dluhové CP vydané ÚI nezatížené
LCR0408	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené do 3 měsíců

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0409	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené od 3 do 6 měsíců
LCR0410	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené od 6 do 9 měsíců
LCR0411	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené od 9 do 12 měsíců
LCR0412	Ostatní dluhové CP vydané ÚI zatížené nad 12 měsíců
LCR0413	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěrové kvality
LCR0414	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1n
LCR0415	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1
LCR0416	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1
LCR0417	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1
LCR0418	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1
LCR0419	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 1
LCR0420	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěrové kvality
LCR0421	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2
LCR0422	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2
LCR0423	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2
LCR0424	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2
LCR0425	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2
LCR0426	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-stupeň úvěr. kvality 2
LCR0427	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěrové kval
LCR0428	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit
LCR0429	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit
LCR0430	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit
LCR0431	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit
LCR0432	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit
LCR0433	Ostatní CP a nástroje peněžního trhu-bez stupně úvěr. kvalit
LCR0434	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul
LCR0435	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul
LCR0436	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul
LCR0437	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul
LCR0438	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul
LCR0439	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul
LCR0440	Majetkové CP nefin.podniků zahrnuté do hlavního indexu regul
LCR0441	Ostatní majetkové cenné papíry
LCR0442	Ostatní majetkové CP nezatížené
LCR0443	Ostatní majetkové CP zatížené do 3 měsíců

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_11

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0444	Ostatní majetkové CP zatížené od 3 do 6 měsíců	
LCR0445	Ostatní majetkové CP zatížené od 6 do 9 měsíců	
LCR0446	Ostatní majetkové CP zatížené od 9 do 12 měsíců	
LCR0447	Ostatní majetkové CP zatížené nad 12 měsíců	
LCR0448	Zlato	
LCR0449	Zlato nezatížené	
LCR0450	Zlato zatížené do 3 měsíců	
LCR0451	Zlato zatížené od 3 měsíců do 6 měsíců	
LCR0452	Zlato zatížené od 6 měsíců do 9 měsíců	
LCR0453	Zlato zatížené od 9 měsíců do 12 měsíců	
LCR0454	Zlato zatížené nad 12 měsíců	
LCR0455	Ostatní drahé kovy	
LCR0456	Ostatní drahé kovy nezatížené	
LCR0457	Ostatní drahé kovy zatížené do 3 měsíců	
LCR0458	Ostatní drahé kovy zatížené od 3 měsíců do 6 měsíců	
LCR0459	Ostatní drahé kovy zatížené od 6 měsíců do 9 měsíců	
LCR0460	Ostatní drahé kovy zatížené od 9 měsíců do 12 měsíců	
LCR0461	Ostatní drahé kovy zatížené nad 12 měsíců	
LCR0547	Položky vyžadující stabilní financování	

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

n11T - n11 (11 číselných znaků v násobku 1 tisíc)

**Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK	Měny pro likviditu a SF
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Výčet : Z_PASSPL	Pásma splatnosti pro stabilní financování
P0635	Likvidita a stabilní financování	Výčet : Z_AKTVYSLIK	Aktiva vysoké likvidity a ostatní aktiva

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 120	Poslední den sledovaného čtvrtletí
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

**Datový soubor:** LISIFE20

**Akronym:** LIS (ČNB) 20-04

**Datová oblast:** LIS20\_11

**Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:**

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

**Poznámka:**

**Verze:**1.0

**Stav:**Platný

**Platnost od:**01.01.2014

**Zdroj:**

**Garant:** /

Datová oblast: LIS20\_12

Název: Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky

**Charakteristika:**

Přehled části aktiv vyžadujících stabilní financování (zejména neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky, pohledávky z derivátů, aktiva odečtená od kapitálu aj. Tato aktiva se uvádějí v pěti koších (dle čl. 428 (2) CRR) podle data jejich splatnosti nebo nejbližšího data kdy mohou být smluvně splaceny.

Pro opce realizovatelné na přání vykazující osoby, musí vykazující osoba brát v úvahu reputační faktory, které mohou omezit schopnost vykazující osoby opci realizovat. Zejména pokud třetí strana očekává, že opce nebude realizována, musí vykazující osoba počítat s tímto chováním pro účel vykazování aktiv v této datové oblasti.

Aktiva se vykazují podle zbytkové smluvní splatnosti, nikoliv podle očekávané skutečnosti.

Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky se vykazují v členění podle protistrany a dále ve vazbě na čl. 510 CRR v členění podle zatížení: aktiva nezatížená a aktiva zatížená v rozpadu podle doby, po kterou jsou aktiva zatížena.

S aktivy, které mají vazbu na zajištěné úvěrové transakce a transakce na kapitálovém trhu podle čl. 192 CRR se zachází následovně: 1) nezahrnují se aktiva půjčena (v rámci reverzních repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba nevlastní; 2) zahrnují se aktiva zapůjčena (v rámci repo obchodů a výměny kolaterálu), která vykazující osoba stále vlastní; 3) zahrnují se zatížené cenné papíry zapůjčené v rámci repo obchodů, která vykazující osoba stále vlastní a která stále eviduje ve své rozvaze; tyto zatížené cenné papíry se vykazují v relevantní kategorii pro stabilní financování.

V dané datové oblasti se uvádějí pohledávky z derivátů (čisté derivátové položky na straně aktiv, které vykazující osoba počítá podle regulatorních pravidel započtení, nikoliv podle účetních pravidel).

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 .

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0462	Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky
LCR0463	Neobnovitelné úvěry a jiné pohledávky vůči nepodnikajícím FO
LCR0464	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči nepodnikajícím
LCR0465	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči

**Datový typ údajů**

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_12

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0466	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v
LCR0467	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v
LCR0468	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců
LCR0469	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči
LCR0470	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči retailovým SME
LCR0471	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči retailovým
LCR0472	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči r
LCR0473	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v
LCR0474	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v
LCR0475	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců
LCR0476	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené ve lhůtě nad 12 mě
LCR0477	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči ústř.vládám, centr. ba
LCR0478	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči ústř.vládám
LCR0479	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči ú
LCR0480	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v
LCR0481	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v
LCR0482	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců
LCR0483	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči
LCR0484	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči nefinančním zákazníkům
LCR0485	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči nefinančním
LCR0486	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči n
LCR0487	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v
LCR0488	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v
LCR0489	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců
LCR0490	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči
LCR0491	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči úvěrovým institucím
LCR0492	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči ÚI
LCR0493	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči Ú
LCR0494	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v
LCR0495	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v
LCR0496	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců
LCR0497	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči
LCR0498	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. vůči finančním zákazníkům j
LCR0499	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. nezatížené vůči finančním z
LCR0500	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené do 3 měsíců vůči f

Datový typ údajů



Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_12

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0501	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 3 do 6 měsíců v
LCR0502	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 6 do 9 měsíců v
LCR0503	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené od 9 do 12 měsíců
LCR0504	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zatížené nad 12 měsíců vůči
LCR0505	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zajištěné nemovitostmi
LCR0506	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zajištěné obchodními nemovi
LCR0507	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. zajištěné obytnými nemovito
LCR0508	Neobnovitelné úvěry a jiné pohl. spolufinancované krytými dl
LCR0509	Pohledávky z derivátů
LCR0510	Ostatní aktiva
LCR0511	Aktiva odečítaná od kapitálu
LCR0512	Nevyčerpané úvěrové přísliby se středním nebo středně nízkým
LCR0548	Položky vyžadující stabilní financování

**Datový typ údajů**

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

n11T - n11 (11 číselných znaků v násobku 1 tisíc)

**Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK	Měny pro likviditu a SF
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Výčet : Z_PASSPL	Pásma splatnosti pro stabilní financování

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 120	Poslední den sledovaného čtvrtletí
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

**Datový soubor:** LISIFE20

**Akronym:** LIS (ČNB) 20-04

**Datová oblast:** LIS20\_12

**Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:**

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

**Poznámka:**

**Verze:**1.0

**Stav:**Platný

**Platnost od:**01.01.2014

**Zdroj:**

**Garant:** /

**Datový soubor:** LISIFE20

**Akronym:** LIS (ČNB) 20-04

**Datová oblast:** LIS20\_21

**Název:** Položky zajišťující stabilní financování

**Charakteristika:**

Přehled položek vyžadujících stabilní financování (položky kapitálu po příp. odpočtu a závazky nezahrnuté do kapitálu). Všechny tyto položky se uvádějí v pěti koších (dle čl. 427 (2) CRR) podle data jejich splatnosti nebo nejbližšího data kdy mohou být smluvně splaceny. Vklady na viděnou se vykazují v koši se splatností do 3 měsíců. Vykazující osoba musí předpokládat, že investor splatí kupní opci v první možný den. Pro financování opcí realizovatelných na přání vykazující osoby, je třeba brát v úvahu reputační faktor, které může omezit schopnost vykazující osoby opci realizovat. Zejména pokud trh očekává, že určité závazky budou splaceny před konečnou smluvní splatností, musí vykazující osoba počítat s tímto chováním trhu. Retailové vklady vykazované v dané datové oblasti (informační prvky LCR0519 - LCR0521) se posuzují z hlediska splatnosti stejně jako v hlášení o likviditě. V dané datové oblasti se uvádějí závazky z derivátů (čisté derivátové položky na straně závazků, které vykazující osoba počítá podle regulatorních pravidel započtení, nikoliv podle účetních pravidel).

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 .

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0513	Kapitál	
LCR0514	Tier 1 (T1) kapitál	
LCR0515	Tier 2 (T2) kapitál	
LCR0516	Prioritní akcie a kap.nástroje nad rámec T2 se splatností al	
LCR0517	Závazky (bez kapitálu)	
LCR0518	Retailové vklady	
LCR0519	Pojištěné retailové vklady	
LCR0520	Ostatní pojištěné a nepojištěné retailové vklady	

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_21

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0521	Retailové vklady s odlišným odtokem
LCR0522	Závazky vůči nefinančním zákazníkům
LCR0523	Závazky vůči NZ ze zajištěných půjček a z transakcí na kap.
LCR0524	Závazky vůči NZ zajištěné aktivity s velmi vysokou likviditou
LCR0525	Závazky vůči NZ zajištěné aktivity s vysokou likviditou a úvěr
LCR0526	Závazky vůči NZ zajištěné ostatními aktivy
LCR0527	Závazky vůči NZ z nezajištěných úvěrů
LCR0528	Závazky vůči NZ se zacházením dle čl. 422 (3) nebo (4) CRR
LCR0529	Pojištěné závazky vůči NZ, které musí být drženy vkladatelem
LCR0530	Závazky vůči NZ v rámci institucionálního systému ochrany
LCR0531	Závazky vůči NZ k zajištění clearingů, úschovy, správy hotov
LCR0532	Závazky vůči finančním zákazníkům
LCR0533	Závazky vůči FZ ze zajištěných půjček a transakce na kap. tr
LCR0534	Závazky vůči FZ zajištěné aktivity s velmi vysokou likviditou
LCR0535	Závazky vůči FZ zajištěné aktivity s vysokou likviditou a úvěr
LCR0536	Závazky vůči FZ zajištěné ostatními aktivy
LCR0537	Závazky vůči FZ z nezajištěných půjček
LCR0538	Závazky vůči FZ se zacházením dle čl. 422 odst. (3) nebo (4)
LCR0539	Pojištěné závazky vůči FZ, které musí být drženy vkladatelem
LCR0540	Závazky vůči FZ v rámci institucionálního systému ochrany
LCR0541	Závazky vůči FZ k zajištění clearingů, úschovy, správy hotov
LCR0542	Závazky z krytých dluhopisů
LCR0543	Závazky z vydaných CP podle čl. 52 (4) směrnice 2009/65/ES
LCR0544	Ostatní závazky vyplývající z vydaných CP
LCR0545	Závazky ze splatných derivátových kontraktů
LCR0546	Všechny ostatní závazky
LCR0549	Položky zajišťující stabilní financování

**Datový typ údajů**

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

nl1T - nl1 (11 číselných znaků v násobku 1 tisíc)

**Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : Z_MENLIK	Měny pro likviditu a SF
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Výčet : Z_PASSPL	Pásma splatnosti pro stabilní financování

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_21

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

Kód	Název	Operátor : Hodnota	Název hodnoty
P0011	Časová charakteristika	Položka : 120	Poslední den sledovaného čtvrtletí
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE20

Akronym: LIS (ČNB) 20-04

Datová oblast: LIS20\_21

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Stav:Platný

Platnost od:01.01.2014

Zdroj:

Garant: /