

**POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR****Datový soubor:** LISIFE10**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12**Název:** Likvidita**Datová oblast:** LIS10\_11**Název:** Likvidní aktiva**Charakteristika:**

Přehled částí likvidních aktiv splňujících požadavky podle čl. 416 a 417 CRR potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky C 51.00 Krytí likvidity - likvidní aktiva (položky 1. až 1.6.2) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS. Zahrnuje hotovost, expozice vůči centrální bance, ostatní převoditelná aktiva (pohledávky nebo zaručená aktiva), akcie nebo podílové jednotky, pohotovostní úvěrové přísliby poskytované centrálními bankami, vklady u ústřední úvěrové instituce vč. specifikace a detailů, v požadované hodnotě.

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 (Likvidní aktiva) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0001	Aktiva podle čl. 416 a 417	
LCR0002	Hotovost	
LCR0003	Expozice vůči centrálním bankám	
LCR0004	Expozice vůči centrálním bankám pro krizovou situaci	
LCR0005	Ostatní převoditelná aktiva vč. zaručených představující poh	
LCR0006	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo jimi zar	
LCR0007	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou	
LCR0008	Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou	
LCR0009	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo	
LCR0010	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru	
LCR0011	Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt	
LCR0012	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB nebo jimi zaručené	
LCR0013	Pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB	
LCR0014	Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB	
LCR0015	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabili	
LCR0016	Pohledávky za nástrojem fin. stability nebo mechanismem stab	

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_11

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0017	Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s
LCR0018	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0019	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad. aktivy podle č
LCR0020	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad. aktivy podle čl
LCR0021	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podklad.aktivy podle čl.
LCR0022	Úvěrové přísliby poskytované centrálními bankami
LCR0023	Vklady a likvidní financování od ústřední úvěr. instituce ne
LCR0024	Vklady u ústřední úvěrové instituce
LCR0025	Likvidní financování od ústřední úvěr.instituce nebo členů s

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_AKTIVA_1	Účetní hodnota, tržní hodnota, hodnota dle čl. 418, nevyčerp

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_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: LIS10\_12

## Název: Likvidní aktiva podle stupně likvidity a úvěrové kvality

## Charakteristika:

Přehled částí likvidních aktiv splňujících podmínky dle čl. 416 a 417 CRR podle stupně likvidity a úvěrové kvality potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky C 51.00 Krytí likvidity - likvidní aktiva (položky 1.7 až 3.12) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS. Zahrnuje aktiva vydaná vykazující osobou, která byla zřízena ústřední nebo regionální vládou členského státu, dluhové cenné papíry nefinančních podniků a institucí, nástroje zajištěné nemovitostmi a položky likvidních aktiv, na něž se vztahuje doplňková vykazovací povinnost.

Při členění aktiv podle stupně likvidity a úvěrové kvality se postupuje podle čl. 416 (1) CRR, tj. než bude stanovena jednotná definice vysoké a velmi vysoké likvidity a vysoké a velmi vysoké úvěrové kvality v souladu s čl. 460 CRR, instituce samy identifikují převoditelná aktiva (v dané měně) vysoké a velmi vysoké likvidity a vysoké a velmi vysoké úvěrové kvality.

Všechny položky se vykazují souhrnně v CZK bez ohledu na jejich skutečnou denominaci podle čl. 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 (Likvidní aktiva) implementačních technických standardů.

## Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0047	Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou po
LCR0048_001	*Dluhové cenné papíry nefinančních podniků
LCR0048_002	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0048_003	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0048_004	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0049_001	*Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)
LCR0049_002	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú
LCR0049_003	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro
LCR0049_004	Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěrov
LCR0050_001	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI
LCR0050_002	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0050_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_12

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0050_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0051_001	*CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI
LCR0051_002	* CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - s
LCR0051_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0051_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI- stup
LCR0052_001	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI
LCR0052_002	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0052_003	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0052_004	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0053_001	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0053_002	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0053_003	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0053_004	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0054_001	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0054_002	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0054_003	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0054_004	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0055	Aktiva dle čl. 416 (1) (b) a (d) nesplňující čl. 417 (b) a (
LCR0056	Aktiva nekontrolována funkcí řízení likvidity
LCR0057	Aktiva snadno nezpeněžitelná do 30 dnů
LCR0058	Položky podléhající doplňkovému vykazování likvidních aktiv
LCR0059	Hotovost
LCR0060	Expozice vůči centrálním bankám pro krizovou situaci
LCR0061	Pohledávky z převod. CP s RV 0%
LCR0062	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za státy
LCR0063	Pohledávky z převod. CP s RV 0% zaručené státy
LCR0064	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za centr. bankami nebo jimi
LCR0065	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za subj. veřej.sekt., region
LCR0066	Pohledávky z převod.CP s RV 0% za BIS, MMF, EK, MRB, nástro
LCR0067	Ostatní pohledávky z převod. CP za státem nebo centr.bankou
LCR0068	Pohledávky z převod. CP s RV 20%
LCR0069	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za státy
LCR0070	Pohledávky z převod. CP s RV 20% zaručené státy
LCR0071	Pohledávky z převod. CP s RV 20%.za centr. bankami nebo jimi
LCR0072	Pohledávky z převod.CP s RV 20 % za subj. veřej.sekt., regi

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_12

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0073	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za MRB nebo jimi zaručené
LCR0074	Ostatní pohledávky z převod.CP s RV 20% nebo lepší
LCR0075	Pohledávky z převod.CP s RV 50% nebo lepší
LCR0076	Pohledávky z převod.CP s RV 35% nebo lepší
LCR0077	Pohotovostní úvěrové přísliby poskytované centrálními bankám
LCR0078	Minimální vklady a další likvidní financování od ústřední úv
LCR0079	Kmenové akcie obchodované na burze
LCR0080	Fyzicky alokované zlato registrované na uznané burze
LCR0166	Aktiva dle čl. 416 a 417

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_AKTIVA_2	Tržní hodnota, hodnota dle čl. 418
P0635	Likvidita a stabilní financování	Výčet : Z_MVLVLAKT	Mimořádně vysoce likvidní a vysoce likvidní aktiva

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_12

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

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0048_001</b> *Dluhové cenné papíry nefinančních podniků	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0048_002</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0048_003</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0048_004</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0049_001</b> *Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0049_002</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0049_003</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0049_004</b> Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěrov	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_12**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0050_001</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0050_002</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0050_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0050_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0051_001</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0051_002</b> * CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - s	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0051_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0051_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI- stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3



**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_12**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0052_001</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0052_002</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0052_003</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0052_004</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0053_001</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0053_002</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0053_003</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0053_004</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_12

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0054_001</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0054_002</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0054_003</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0054_004</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Poznámka :**

**Verze:** 1.0  
**Zdroj:**

**Stav:** Platný  
**Garant:** /

**Platnost od:** 01.01.2014

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_13

**Název:** Likvidní aktiva - další údaje

**Charakteristika:**

Přehled částí likvidních aktiv nesplňujících podmínky dle čl. 416 a splňujících podmínky dle čl. 417 (b) a (c) CRR, postup řešení při nedostatku likvidních aktiv a aktiva, která jsou v souladu s právem šaria jako alternativa k specifikovaným likvidním aktivům aj., potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky C 51.00 Krytí likvidity - likvidní aktiva (položky 4. až 6.3) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

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 (Likvidní aktiva) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0026	Aktiva dle čl. 417 b) a c), nesplňující podmínky čl. 416	
LCR0027_001	*Dluhové CP finančních subjektů	
LCR0027_002	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1	
LCR0027_003	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2	
LCR0027_004	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3	
LCR0028_001	*Vlastní emise cenných papírů	
LCR0028_002	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1	
LCR0028_003	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2	
LCR0028_004	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3	
LCR0029_001	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí	
LCR0029_002	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	
LCR0029_003	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	
LCR0029_004	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	
LCR0030_001	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti	
LCR0030_002	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	
LCR0030_003	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	
LCR0030_004	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	
LCR0031_001	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytné nemovitosti	
LCR0031_002	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytné nemovitosti - stup	

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_13

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0031_003	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0031_004	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0032	Kotované akcie nebo kap.nástroje zahrnuté do hlavního indexu
LCR0033	Ostatní zlato
LCR0034	Ostatní zaručené dluhové CP
LCR0035	Ostatní kryté dluhopisy
LCR0036	Ostatní podnikové dluhové CP
LCR0037	Fondy nabývající aktiva podle čl. 509 (3) (c) CRR
LCR0038	Ostatní CP nebo pohledávky přijímané centr. bankou jako kola
LCR0039	Dluhové CP vydané místními vládami
LCR0040	Obchodní cenné papíry
LCR0041	Úvěrové pohledávky
LCR0042	Postupy řešení při nedostatku likvidních aktiv
LCR0043	Použití odchylky A (zahraniční měna)
LCR0044	Použití odchylky B (úvěrové linky centrální banky)
LCR0046_001	Finanční produkty podle práva šaría
LCR0046_002	*Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit
LCR0046_003	*Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit
LCR0046_004	*Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_AKTIVA_3	Tržní hodnota, hodnota podle čl. 418 CRR, účetní hodnota

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_13

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0633
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0027_001</b> *Dluhové CP finančních subjektů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0027_002</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0027_003</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0027_004</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0028_001</b> *Vlastní emise cenných papírů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0028_002</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0028_003</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0028_004</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_13**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0029_001</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0029_002</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0029_003</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0029_004</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0030_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0030_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0030_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0030_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_13**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0031_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0031_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0031_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0031_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0046_001</b> Finanční produkty podle práva šaría	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0046_002</b> *Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0046_003</b> *Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0046_004</b> *Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Poznámka :**

**Popis DO pro DS**

**Strana:15/90**

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_13

**Verze:** 1.0

**Stav:** Platný

**Platnost od:** 01.01.2014

**Zdroj:**

**Garant:** /



**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_21

**Název:** Odtoky retailových vkladů

**Charakteristika:**

Přehled stavu retailových vkladů a odtoků retailových vkladů podle čl. 421 CRR očekávaných během příštích 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Rovněž tak se uvádí stav ostatních závazků z vlastních provozních výdajů podle čl. 422 (1) CRR splatných do 30 dnů a jejich očekávané odtoky během příštích 30 dnů. Odpovídá části tabulky 52.00 Krytí likvidity - odtoky (položky 1.1 až 1.2.1) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Hodnota odtoku se odvozuje ze stavu retailových vkladů ke konci vykazovacího období, u ostatních závazků z vlastních provozních výdajů z hodnoty, u které se očekává, že bude splatná během příštích 30 dnů. Patří sem závazky, které mají nejbližší smluvní splatnost během příštích 30 dnů nebo nedefinovanou splatnost, přičemž se při určení nejbližší splatnosti bere v úvahu jak možnost výpovědi investorem, tak vykazující osobou, kde je možnost nevyužití opce limitována reputačními důvody. Dále platí, že tam, kde trh očekává, že určitý závazek bude splacen v průběhu příštích 30 dnů, i když jeho smluvní termín splatnosti je delší, pak je takový závazek zahrnován do očekávaných odtoků.

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 Odtoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0081	Odtoky	
LCR0082	Retailové vklady	
LCR0083	Pojištěné retailové vklady	
LCR0084	Pojištěné retailové vklady s vysoce nepravděpodobným výběrem	
LCR0085	Pojištěné retailové vklady na transakčních účtech	
LCR0086	Ostatní pojištěné retailové vklady	
LCR0087	Nepojištěné retailové vklady	
LCR0088	Retailové vklady s odlišným odtokem	
LCR0089	Retailové vklady s odlišným odtokem - kategorie 1	
LCR0090	Retailové vklady s odlišným odtokem - kategorie 2	
LCR0091	Retailové vklady s odlišným odtokem - kategorie 3	

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_21

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0092	Retailové vklady přijaté ve třetích zemích	
LCR0093	Retailové vklady vyjmuté z výpočtu odtoku	
LCR0094	Odtoky ostatních závazků splatných do 30 dnů	
LCR0095	Závazky z vlastních provozních výdajů splatných do 30 dnů	

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_UHHOOD	Účetní hodnota, hodnota odtoku

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_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:** /

Datová oblast: LIS10\_22

Název: Odtoky závazků ze zajištěných úv. transakcí a transakcí na K

**Charakteristika:**

Přehled závazků ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na kapitálovém trhu dle čl. 422 (2) splatných do 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 52.00 Krytí likvidity - odtoky (položky 1.2,2 až 1.2.2.14.1.3) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS. Zahrnují se všechny transakce ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na kapitálovém trhu podle čl. 192 CRR. Zahrnují se transakce, v rámci kterých vykazující osoba přijala kolateralizovaný úvěr v hotovosti (repo) podle čl. 4 (59) CRR. Uvádí se tržní hodnota odpovídajících aktiv, která zajišťují výše uvedené závazky (poskytnuté jako kolaterál). Patří sem závazky, které mají nejbližší smluvní splatnost během příštích 30 dnů nebo nedefinovanou splatnost, přičemž při určení nejbližší splatnosti se bere v úvahu jak možnost výpovědi investorem, tak vykazující osobou, kde je možnost nevyužití možnosti výpovědi limitována reputačními důvody. Dále platí, že tam, kde trh očekává, že určitý závazek bude splacen během příštích 30 dnů, i když jeho smluvní termín splatnosti nebo vypořádání je delší, pak je takový závazek zahrnován do očekávaných odtoků. U výměny kolaterálu (collateral swaps), kdy vykazující osoba souběžně přijímá a poskytuje kolaterál (v podobě jiné než hotovost), se v této datové oblasti vykazuje tržní hodnota přijatého kolaterálu (hodnota poskytnutého kolaterálu se vykáže v části Přitoky).

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 Odtoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0096	Závazky ze zajišt.úvěr.transakcí a transakcí na kap. trhu	
LCR0097	Ostatní převoditelná aktiva vč. zaručených představující poh	
LCR0098	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo aktiva j	
LCR0099	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou	
LCR0100	Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou	
LCR0101	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo	
LCR0102	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru	
LCR0103	Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt	
LCR0104	Pohledávky za BMP, MMF, EK. MRB nebo aktiva jimi zaručená	
LCR0105	Pohledávky za BMP, MMF, EK a MRB	

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_22

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

Kód	Název
LCR0106	Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB
LCR0107	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit
LCR0108	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit
LCR0109	Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s
LCR0110	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0111	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (a) akcií nebo podílů
LCR0112	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (b) a (c) ) akcií nebo
LCR0113	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (d) ) akcií nebo podílů
LCR0114	Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou po
LCR0115_001	*Dluhové cenné papíry nefinančních podniků
LCR0115_002	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0115_003	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0115_004	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0116_001	*Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)
LCR0116_002	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú
LCR0116_003	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro
LCR0116_004	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro
LCR0117_001	* CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI
LCR0117_002	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0117_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0117_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0118_001	* CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI
LCR0118_002	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI - st
LCR0118_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0118_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI- stup
LCR0119_001	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI
LCR0119_002	*Ostatní dluhové CP vydané Ú - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0119_003	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0119_004	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0120_001	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0120_002	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0120_003	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0120_004	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0121_001	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0121_002	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_22

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0121_003	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0121_004	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0122	Aktiva dle čl. 416 (1) (b) a (d). nesplňující čl. 417 (b) a
LCR0123	Aktiva nekontrolována funkcí řízení likvidity
LCR0124	Aktiva snadno nezpeněžitelná do 30 dnů
LCR0125	Položky podléhající doplňkovému vykazování likvidních aktiv
LCR0126	Hotovost
LCR0127	Expozice vůči centrálním bankám čerpatelné v krizové situaci
LCR0128	Pohledávky z převod. CP s RV 0%
LCR0129	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za státy
LCR0130	Pohledávky z převod. CP s RV 0% zaručené státy
LCR0131	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za centr. bankami nebo jimi
LCR0132	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za subj. veřej.sekt., region
LCR0133	Pohledávky z převod.CP s RV 0% za BIS, MMF, EK, MRB, nástro
LCR0134	Ostatní pohledávky z převod. CP za státem nebo centr.bankou
LCR0135	Převoditelné CP s RV 20% nepředstavující závazek vyk. ani p
LCR0136	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za státy
LCR0137	Pohledávky z převod. CP s RV 20% zaručené státy
LCR0138	Pohledávky z převod. CP s RV 20%.za centr. bankami nebo jimi
LCR0139	Pohledávky z převod.CP s RV 20 % za subj. veřej.sekt., regi
LCR0140	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za MRB nebo jimi zaručené
LCR0141	Ostatní pohledávky z převod.CP s RV 20% nebo lepší
LCR0142	Pohledávky z převod.CP s RV 50% nebo lepší
LCR0143	Pohledávky z převod.CP s RV 35% nebo lepší
LCR0144	Pohotovostní úvěrové přísliby poskytované centr. bankami
LCR0145	Minimální vklady a další likvidní financování od ústřední úv
LCR0146	Kmenové akcie obchodované na burze
LCR0147	Fyzicky alokované zlato registrované na uznané burze
LCR0148	Aktiva dle čl. 417 b) a c), nesplňující podmínky čl. 416
LCR0149_001	*Dluhové CP finančních subjektů
LCR0149_002	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0149_003	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0149_004	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0150_001	*Vlastní emise cenných papírů
LCR0150_002	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1

**Datový typ údajů**

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_22

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0150_003	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0150_004	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0151_001	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí
LCR0151_002	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0151_003	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0151_004	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0152_001	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti
LCR0152_002	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0152_003	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0152_004	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0153_001	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti
LCR0153_002	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0153_003	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0153_004	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0154	Kótované akcie nebo kap.nástroje zahrnuté do hlavního indexu
LCR0155	Ostatní zlato
LCR0156	Ostatní zaručené dluhové CP
LCR0157	Ostatní kryté dluhopisy
LCR0158	Ostatní podnikové dluhové CP
LCR0159	Fondy nabývající aktiva podle čl. 509 (3) (c) CRR
LCR0160	Ostatní CP nebo pohledávky přijaté centr. bankou jako kolate
LCR0161	Dluhové CP místních vlád
LCR0162	Obchodní cenné papíry
LCR0163	Úvěrové pohledávky
LCR0164_001	*Finanční produkty podle práva šaría
LCR0165_001	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA
LCR0165_002	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup
LCR0165_003	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup
LCR0165_004	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup
LCR0167	Odtoky
LCR0168	Odtoky ostatních závazků

**Datový typ údajů**

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

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

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_22

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_TRZHOD	Tržní hodnota

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Položka : 95	Nelze specifikovat
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi
P0635	Likvidita a stabilní financování	Položka : 99	Nerozlišeno



Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_22

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0633
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0096</b> Závazky ze zajišť.úvěr.transakcí a transakcí na kap. trhu	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0097</b> Ostatní převoditelná aktiva vč. zaručených představující poh	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0098</b> Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo aktiva j	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0099</b> Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0100</b> Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0101</b> Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0102</b> Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0103</b> Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0104</b> Pohledávky za BMP, MMF, EK. MRB nebo aktiva jimi zaručená	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0105</b> Pohledávky za BMP, MMF, EK a MRB	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0106</b> Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0107</b> Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0108</b> Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0109</b> Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0110</b> Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0111</b> Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (a) akcií nebo podílů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0112</b> Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (b) a (c) ) akcií nebo	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0113</b> Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (d) ) akcií nebo podílů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0114</b> Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou po	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0115_001</b> *Dluhové cenné papíry nefinančních podniků	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0115_002</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0115_003</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0115_004</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0116_001</b> *Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0116_002</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0116_003</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0116_004</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0117_001</b> * CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0117_002</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0117_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0117_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0118_001</b> * CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0118_002</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - st	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0118_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0118_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI- stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0119_001</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0119_002</b> *Ostatní dluhové CP vydané Ú - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0119_003</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0119_004</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0120_001</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_22

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0120_002</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0120_003</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0120_004</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0121_001</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0121_002</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0121_003</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0121_004</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0122</b> Aktiva dle čl. 416 (1) (b) a (d). nesplňující čl. 417 (b) a	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_22

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0123</b> Aktiva nekontrolována funkcí řízení likvidity	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0124</b> Aktiva snadno nezpeněžitelná do 30 dnů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0125</b> Položky podléhající doplňkovému vykazování likvidních aktiv	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0126</b> Hotovost	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0127</b> Expozice vůči centrálním bankám čerpatelné v krizové situaci	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0128</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0%	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0129</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% za státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0130</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% zaručené státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0131</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% za centr. bankami nebo jimi	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0132</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% za subj. veřej.sekt., region	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0133</b> Pohledávky z převod.CP s RV 0% za BIS, MMF, EK, MRB, nástro	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0134</b> Ostatní pohledávky z převod. CP za státem nebo centr.bankou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0135</b> Převoditelné CP s RV 20% nepředstavující závazek vyk. ani p	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0136</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20% za státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0137</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20% zaručené státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0138</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20%.za centr. bankami nebo jimi	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem



**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0139</b> Pohledávky z převod.CP s RV 20 % za subj. veřej.sekt., regi	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0140</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20% za MRB nebo jimi zaručené	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0141</b> Ostatní pohledávky z převod.CP s RV 20% nebo lepší	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0142</b> Pohledávky z převod.CP s RV 50% nebo lepší	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0143</b> Pohledávky z převod.CP s RV 35% nebo lepší	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0144</b> Pohotovostní úvěrové přísliby poskytované centr. bankami	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0145</b> Minimální vklady a další likvidní financování od ústřední úv	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0146</b> Kmenové akcie obchodované na burze	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0147</b> Fyzicky alokované zlato registrované na uznané burze	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0148</b> Aktiva dle čl. 417 b) a c), nesplňující podmínky čl. 416	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0149_001</b> *Dluhové CP finančních subjektů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0149_002</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0149_003</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0149_004</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0150_001</b> *Vlastní emise cenných papírů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0150_002</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0150_003</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0150_004</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0151_001</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0151_002</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0151_003</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0151_004</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0152_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0152_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_22**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0152_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0152_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0153_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0153_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0153_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0153_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0154</b> Kótované akcie nebo kap.nástroje zahrnuté do hlavního indexu	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0155</b> Ostatní zlato	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_22

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0156</b> Ostatní zaručené dluhové CP	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0157</b> Ostatní kryté dluhopisy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0158</b> Ostatní podnikové dluhové CP	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0159</b> Fondy nabývající aktiva podle čl. 509 (3) (c) CRR	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0160</b> Ostatní CP nebo pohledávky přijaté centr. bankou jako kolate	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0161</b> Dluhové CP místních vlád	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0162</b> Obchodní cenné papíry	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0163</b> Úvěrové pohledávky	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_22

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0164_001</b> *Finanční produkty podle práva šaría	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0165_001</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0165_002</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0165_003</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0165_004</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0167</b> Odtoky	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0168</b> Odtoky ostatních závazků	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Poznámka :**

**Verze:**1.0  
**Zdroj:**

**Stav:**Platný  
**Garant:** /

**Platnost od:**01.01.2014

**Datová oblast: LIS10\_23**

**Název: Odtoky závazků ze zajištěných úv. transakcí a transakcí na K**

**Charakteristika:**

Přehled závazků ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na kapitálovém trhu dle čl. 422 (2) splatných během do 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 52.00 Krytí likvidity - odtoky (položky 1.2,2 až 1.2.2.14.1.3) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS v členění podle stupně likviditní a úvěrové kvality aktiv.

Zahrnují se všechny transakce ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na kapitálovém trhu podle čl. 192 CRR.

Zahrnují se transakce, v rámci kterých vykazující osoba přijala kolateralizovaný úvěr v hotovosti (repo) podle čl. 4 (59) CRR. Uvádí se hodnota těchto aktiv podle čl. 418 CRR.

Vyazuje se hodnota závazků, která má být splacena nebo vypořádána během příštích 30 dnů. Patří sem závazky, které mají nejbližší smluvní splatnost během příštích 30 dnů nebo nedefinovanou splatnost, přičemž při určení nejbližší splatnosti se bere v úvahu jak možnost výpovědi investorem, tak vykazující osobou, kde je možnost nevyužití možnosti výpovědi limitována reputačními důvody. Dále platí, že tam, kde trh očekává, že určitý závazek bude splacen během příštích 30 dnů, i když jeho smluvní termín splatnosti nebo vypořádání je delší, pak je takový závazek zahrnován do očekávaných odtoků. U výměny kolaterálu (collateral swaps), kdy vykazující osoba souběžně přijímá a poskytuje kolaterál (v podobě jiné než hotovost), se v dané datové oblasti vyazuje tržní hodnota přijatého kolaterálu (hodnota poskytnutého kolaterálu se vykáže v části Přitoky).

Transakce se vykazují v členění podle stupně likvidity a úvěrové kvality aktiv použitých k zajištění transakcí, a to s použitím stejných kritérií jako v datové oblasti LIS10\_12 Likvidní aktiva podle stupně likvidity a úvěrové kvality. Při členění aktiv se postupuje podle čl. 416 (1) CRR, tj. než bude stanovena jednotná definice vysoké a velmi vysoké likvidity a vysoké a velmi vysoké úvěrové kvality v souladu s čl. 460 CRR, instituce samy identifikují převoditelná aktiva (v dané měně) vysoké a velmi vysoké likvidity a vysoké a velmi vysoké úvěrové kvality.

Pokud vykazující osoba vložila aktiva s velmi vysokou, vysokou a ostatní likviditní a úvěrovou kvalitou do poolu (seskupení) a jednotlivá aktiva nejsou jednoznačně přiřazena k jednotlivým zajištěným úvěrovým transakcím a transakcím na kapitálovém trhu, pak vykazující osoba přiřadí jako první aktiva s nejnižší likviditní a úvěrovou kvalitou (tj. ostatní aktiva), v dalším kroku přiřadí aktiva s vysokou likviditní a úvěrovou kvalitou, a až na konec přiřadí aktiva s velmi vysokou likviditní a úvěrovou kvalitou.

U výměny kolaterálu (collateral swaps), kdy vykazující osoba souběžně přijímá a poskytuje kolaterál (v podobě jiné než hotovost), se v dané datové oblasti vyazuje hodnota přijatého kolaterálu podle čl. 418 CRR. Hodnota poskytnutého kolaterálu se vykáže v části Přitoky. Vzhledem k tomu, že výměna kolaterálu se vztahuje pouze ke kolaterálu, nevyazuje se splatná hodnota, ale pouze hodnota podle čl. 418 CRR.

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

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_23

**Charakteristika:**

na úvěrové instituce a investiční podniky,

- ITS odkazuje na Přílohu XII a XIII (část Odtoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0096	Závazky ze zajišť.úvěř.transakcí a transakcí na kap. trhu	
LCR0097	Ostatní převoditelná aktiva vč. zaručených představující poh	
LCR0098	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo aktiva j	
LCR0099	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou	
LCR0100	Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou	
LCR0101	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo	
LCR0102	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru	
LCR0103	Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt	
LCR0104	Pohledávky za BMP, MMF, EK. MRB nebo aktiva jimi zaručená	
LCR0105	Pohledávky za BMP, MMF, EK a MRB	
LCR0106	Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB	
LCR0107	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabili	
LCR0108	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit	
LCR0109	Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s	
LCR0110	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	
LCR0111	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (a) akcií nebo podílů	
LCR0112	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (b) a (c) ) akcií nebo	
LCR0113	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (d) ) akcií nebo podílů	
LCR0114	Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou po	
LCR0115_001	*Dluhové cenné papíry nefinančních podniků	
LCR0115_002	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1	
LCR0115_003	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2	
LCR0115_004	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3	
LCR0116_001	*Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)	
LCR0116_002	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú	
LCR0116_003	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	
LCR0116_004	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	
LCR0117_001	* CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI	
LCR0117_002	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	
LCR0117_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	



Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_23

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0117_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0118_001	* CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI
LCR0118_002	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI - st
LCR0118_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0118_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI- stup
LCR0119_001	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI
LCR0119_002	*Ostatní dluhové CP vydané Ú - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0119_003	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0119_004	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0120_001	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0120_002	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0120_003	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0120_004	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0121_001	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0121_002	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0121_003	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0121_004	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0122	Aktiva dle čl. 416 (1) (b) a (d). nesplňující čl. 417 (b) a
LCR0123	Aktiva nekontrolována funkcí řízení likvidity
LCR0124	Aktiva snadno nezpeněžitelná do 30 dnů
LCR0125	Položky podléhající doplňkovému vykazování likvidních aktiv
LCR0126	Hotovost
LCR0127	Expozice vůči centrálním bankám čerpitelné v krizové situaci
LCR0128	Pohledávky z převod. CP s RV 0%
LCR0129	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za státy
LCR0130	Pohledávky z převod. CP s RV 0% zaručené státy
LCR0131	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za centr. bankami nebo jimi
LCR0132	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za subj. veřej.sekt., region
LCR0133	Pohledávky z převod.CP s RV 0% za BIS, MMF, EK, MRB, nástro
LCR0134	Ostatní pohledávky z převod. CP za státem nebo centr.bankou
LCR0135	Převoditelné CP s RV 20% nepředstavující závazek vyk. ani p
LCR0136	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za státy
LCR0137	Pohledávky z převod. CP s RV 20% zaručené státy
LCR0138	Pohledávky z převod. CP s RV 20%.za centr. bankami nebo jimi
LCR0139	Pohledávky z převod.CP s RV 20 % za subj. veřej.sekt., regi

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_23

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0140	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za MRB nebo jimi zaručené
LCR0141	Ostatní pohledávky z převod.CP s RV 20% nebo lepší
LCR0142	Pohledávky z převod.CP s RV 50% nebo lepší
LCR0143	Pohledávky z převod.CP s RV 35% nebo lepší
LCR0144	Pohotovostní úvěrové přísliby poskytované centr. bankami
LCR0145	Minimální vklady a další likvidní financování od ústřední úv
LCR0146	Kmenové akcie obchodované na burze
LCR0147	Fyzicky alokované zlato registrované na uznané burze
LCR0148	Aktiva dle čl. 417 b) a c), nesplňující podmínky čl. 416
LCR0149_001	*Dluhové CP finančních subjektů
LCR0149_002	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0149_003	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0149_004	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0150_001	*Vlastní emise cenných papírů
LCR0150_002	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0150_003	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0150_004	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0151_001	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí
LCR0151_002	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0151_003	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0151_004	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0152_001	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti
LCR0152_002	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0152_003	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0152_004	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0153_001	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti
LCR0153_002	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0153_003	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0153_004	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obytl. nemovitosti - stup
LCR0154	Kótované akcie nebo kap.nástroje zahrnuté do hlavního indexu
LCR0155	Ostatní zlato
LCR0156	Ostatní zaručené dluhové CP
LCR0157	Ostatní kryté dluhopisy
LCR0158	Ostatní podnikové dluhové CP
LCR0159	Fondy nabývající aktiva podle čl. 509 (3) (c) CRR

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_23

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0160	Ostatní CP nebo pohledávky přijaté centr. bankou jako kolate
LCR0161	Dluhové CP místních vlád
LCR0162	Obchodní cenné papíry
LCR0163	Úvěrové pohledávky
LCR0164_001	*Finanční produkty podle práva šaría
LCR0165_001	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA
LCR0165_002	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup
LCR0165_003	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup
LCR0165_004	*Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup
LCR0167	Odtoky
LCR0168	Odtoky ostatních závazků

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_SPLCAHOD	Splatná částka, Hodnota podle čl. 418 CRR
P0635	Likvidita a stabilní financování	Výčet : Z_ODTOK_23	Odtoky - část 3.

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0063	Doba po splatnosti pohledávek	Položka : 95	Nelze specifikovat
P0611	Ukazatel typu výkazu	Položka : SOL	Výkaz na SOLO bázi

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_23

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0633
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0096</b> Závazky ze zajišť.úvěr.transakcí a transakcí na kap. trhu	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0097</b> Ostatní převoditelná aktiva vč. zaručených představující poh	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0098</b> Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo aktiva j	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0099</b> Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0100</b> Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0101</b> Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0102</b> Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0103</b> Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0104</b> Pohledávky za BMP, MMF, EK. MRB nebo aktiva jimi zaručená	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0105</b> Pohledávky za BMP, MMF, EK a MRB	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0106</b> Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0107</b> Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0108</b> Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0109</b> Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0110</b> Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0111</b> Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (a) akcií nebo podílů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0112</b> Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (b) a (c) ) akcií nebo	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0113</b> Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (d) ) akcií nebo podílů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0114</b> Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou po	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0115_001</b> *Dluhové cenné papíry nefinančních podniků	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0115_002</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0115_003</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0115_004</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0116_001</b> *Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0116_002</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0116_003</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0116_004</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0117_001</b> * CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0117_002</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0117_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0117_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0118_001</b> * CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0118_002</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - st	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0118_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0118_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI- stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0119_001</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0119_002</b> *Ostatní dluhové CP vydané Ú - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0119_003</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0119_004</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0120_001</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem



**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0120_002</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0120_003</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0120_004</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0121_001</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0121_002</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0121_003</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0121_004</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0122</b> Aktiva dle čl. 416 (1) (b) a (d). nesplňující čl. 417 (b) a	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_23

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0123</b> Aktiva nekontrolována funkcí řízení likvidity	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0124</b> Aktiva snadno nezpeněžitelná do 30 dnů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0125</b> Položky podléhající doplňkovému vykazování likvidních aktiv	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0126</b> Hotovost	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0127</b> Expozice vůči centrálním bankám čerpatelné v krizové situaci	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0128</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0%	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0129</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% za státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0130</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% zaručené státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0131</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% za centr. bankami nebo jimi	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0132</b> Pohledávky z převod. CP s RV 0% za subj. veřej.sekt., region	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0133</b> Pohledávky z převod.CP s RV 0% za BIS, MMF, EK, MRB, nástro	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0134</b> Ostatní pohledávky z převod. CP za státem nebo centr.bankou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0135</b> Převoditelné CP s RV 20% nepředstavující závazek vyk. ani p	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0136</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20% za státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0137</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20% zaručené státy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0138</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20%.za centr. bankami nebo jimi	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0139</b> Pohledávky z převod.CP s RV 20 % za subj. veřej.sekt., regi	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0140</b> Pohledávky z převod. CP s RV 20% za MRB nebo jimi zaručené	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0141</b> Ostatní pohledávky z převod.CP s RV 20% nebo lepší	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0142</b> Pohledávky z převod.CP s RV 50% nebo lepší	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0143</b> Pohledávky z převod.CP s RV 35% nebo lepší	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0144</b> Pohotovostní úvěrové přísliby poskytované centr. bankami	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0145</b> Minimální vklady a další likvidní financování od ústřední úv	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0146</b> Kmenové akcie obchodované na burze	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0147</b> Fyzicky alokované zlato registrované na uznané burze	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0148</b> Aktiva dle čl. 417 b) a c), nesplňující podmínky čl. 416	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0149_001</b> *Dluhové CP finančních subjektů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0149_002</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0149_003</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0149_004</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0150_001</b> *Vlastní emise cenných papírů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0150_002</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_23

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0150_003</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0150_004</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0151_001</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0151_002</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0151_003</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0151_004</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0152_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0152_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0152_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0152_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0153_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0153_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0153_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0153_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0154</b> Kótované akcie nebo kap.nástroje zahrnuté do hlavního indexu	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0155</b> Ostatní zlato	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_23**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0156</b> Ostatní zaručené dluhové CP	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0157</b> Ostatní kryté dluhopisy	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0158</b> Ostatní podnikové dluhové CP	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0159</b> Fondy nabývající aktiva podle čl. 509 (3) (c) CRR	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0160</b> Ostatní CP nebo pohledávky přijaté centr. bankou jako kolate	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0161</b> Dluhové CP místních vlád	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0162</b> Obchodní cenné papíry	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0163</b> Úvěrové pohledávky	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem



**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_23

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0164_001</b> *Finanční produkty podle práva šaría	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0165_001</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0165_002</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0165_003</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0165_004</b> *Finanční produkty podle práva šaría považované za LA - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0167</b> Odtoky	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0168</b> Odtoky ostatních závazků	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem

**Poznámka :**

**Verze:**1.0  
**Zdroj:**

**Stav:**Platný  
**Garant:** /

**Platnost od:**01.01.2014

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_24

**Název:** Odtoky vkladů, které musí být drženy vkladatelem

**Charakteristika:**

Přehled vkladů, které musí být drženy vkladateli podle čl. 422 (3) a vkladů úvěrových institucí u ústředních úvěrových institucí, které jsou považovány za likvidní aktiva dle čl. 416 (1) (f) splatných do 30 dnů a odtoků z těchto vkladů očekávaných během příštích 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 52.00 Krytí likvidity - odtoky (položky 1.2,3 až 1.2.4) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Zahrnují se vklady splatné na požádání a pevné termínované vklady v členění podle typu klientů (finanční a nefinanční zákazníci), které musí být drženy vkladateli, aby jim mohla být poskytnuta určitá služba, např. clearing, úschova a správa hodnot, řízení hotovosti apod.

Vykazuje se hodnota závazků, která má být splacena nebo vypořádána v průběhu následujících 30 dnů. Patří sem závazky, které mají nejblíže smluvní splatnost během příštích 30 dnů nebo nedefinovanou splatnost, přičemž při určení nejblíže splatnosti se bere v úvahu jak možnost výpovědi investorem, tak vykazující osobou, kde je možnost nevyužití možnosti výpovědi limitována reputačními důvody. Dále platí, že tam, kde trh očekává, že určitý závazek bude splacen během příštích 30 dnů, i když jeho smluvní termín splatnosti nebo vypořádání je delší, pak je takový závazek zahrnován do očekávaných odtoků.

Všechny položky se vykazují souhrnně v CZK bez ohledu na jejich skutečnou denominaci podle čl. 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 Odtoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0169	Odtoky	
LCR0170	Odtoky ostatních závazků	
LCR0171	Vklady, které musí být drženy vkladatelem	
LCR0172	Vklady držené vkladatelem k zajištění clearingů, úschovy, sp	
LCR0173	Vklady kryté systémem pojištěním vkladů	
LCR0174	Pojištěné vklady k zajištění bank. služeb nevybratelné klie	
LCR0175	Pojištěné vklady k zajištění bank služeb vybratelné klientem	
LCR0176	Vklady nekryté systémem pojištěním vkladů	
LCR0177	Nepojištěné vklady k zajištění bank.služeb nevybratelné klie	

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_24

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0178	Nepojištěné vklady k zajištění bank. služeb vybratelné klie
LCR0179	Vklady držené vkladatelem k zajištění ostatních služeb
LCR0180	Vklady držené pro korespondenční bankovníctví nebo makléřské
LCR0181	Vklady držené vkladatelem v rámci institucionálního systému
LCR0182	Vklady držené vkladatelem pro využívání služeb ústřední úvěr
LCR0183	Vklady ÚI uložené u ústředních úvěr.institucí ve formě likv

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_HODVKLHODOD	Hodnota vkladu, hodnota odtoku
P0635	Likvidita a stabilní financování	Výčet : Z_KLIENT	Klienti

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_24

**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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_25

**Název:** Odtoky ostatních vkladů a závazků

**Charakteristika:**

Přehled ostatních vkladů a závazků, které nebyly uvedeny v jiných datových oblastech pro odtoky, splatných do 30 dnů a odtoku z těchto vkladů a závazků očekávaných během příštích 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 52.00 Krytí likvidity - odtoky (položky 1.2,5 až 1.2.10) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Zahrnují se zejména závazky vyplývající z vkladů klientů, kteří nejsou finančními zákazníky, z derivátů, závazky, u kterých regulátor určil individuálně odlišný odtok apod.

Vyazuje se hodnota závazků, která má být splacena nebo vypořádána během příštích 30 dnů. Patří sem závazky, které mají nejbližší smluvní splatnost během příštích 30 dnů nebo nedefinovanou splatnost, přičemž při určení nejbližší splatnosti se bere v úvahu jak možnost výpovědi investorem, tak vykazující osobou, kde je možnost nevyužití možnosti výpovědi limitována reputačními důvody. Dále platí, že tam, kde trh očekává, že určitý závazek bude splacen během příštích 30 dnů, i když jeho smluvní termín splatnosti nebo vypořádání je delší, pak je takový závazek zahrnován do očekávaných odtoků.

Všechny položky se vykazují souhrnně v CZK bez ohledu na jejich skutečnou denominaci podle čl. 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 Odtoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0184	Odtoky	
LCR0185	Odtoky ostatních závazků	
LCR0186	Likviditní linky poskytnuté institucím	
LCR0187	Ostatní vklady nefinančních zákazníků	
LCR0188	Ostatní pojištěné závazky z vkladů nefinančních zákazníků	
LCR0189	Ostatní nepojištěné závazky z vkladů nefinančních zákazníků	
LCR0190	Závazky z derivátových kontraktů	
LCR0191	Závazky s individuálně povoleným nižším odtokem	
LCR0192	Závazky s individuálně povoleným nižším odtokem	
LCR0193	Závazky s individuálně povoleným nižším odtokem v různých ze	
LCR0194	Odtoky nevykázané výše	

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_25

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0195	Závazky s individuálně nařízeným vyšším odtokem
LCR0196	Podrozvahové položky související s financováním obchodu s in
LCR0197	Ostatní závazky

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_HODNOTAOD	Hodnota, hodnota odtoku

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_25

**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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_26

**Název:** Dodatečné odtoky ve vazbě na kolaterál

**Charakteristika:**

Přehled položek podle čl. 423 CRR a dodatečných odtoků z těchto položek, očekávaných během příštích 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 52.00 Krytí likvidity - odtoky (položky 1.3,1 až 1.3.8) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Vyazuje se hodnota závazků, která má být splacena nebo vypořádána během příštích 30 dnů. Patří sem závazky, které mají nejbližší smluvní splatnost během příštích 30 dnů nebo nedefinovanou splatnost, přičemž při určení nejbližší splatnosti se bere v úvahu jak možnost výpovědi investorem, tak vykazující osobou, kde je možnost nevyužití možnosti výpovědi limitována reputačními důvody. Dále platí, že tam, kde trh očekává, že určitý závazek bude splacen během příštích 30 dnů, i když jeho smluvní termín splatnosti nebo vypořádání je delší, pak je takový závazek zahrnován do očekávaných odtoků.

Všechny položky se vykazují souhrnně v CZK bez ohledu na jejich skutečnou denominaci podle čl. 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 Odtoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0198	Odtoky	
LCR0199	Dodatečné odtoky	
LCR0200	Kolaterál jiný než hotovost a expozice vůči centrálním bankám	
LCR0201	Dodatečný kolaterál při zhoršení úvěrové kvality instituce	
LCR0202	Dodatečný kolaterál pro dopady z nepříznivého úvěr. scénáře	
LCR0203	Krátké prodeje nelikvidních CP bez jejich držení	
LCR0204	Přebytečný kolaterál	
LCR0205	Kolaterál vrácený protistraně	
LCR0206	Kolaterál ve formě nahraditelných likvidních aktiv	
LCR0207	Vklady přijaté jako kolaterál	

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

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



Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_26

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_TRZHODOD	Tržní hodnota, hodnota podle čl. 418 CRR, hodnota odtoku

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_26

**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: LIS10\_27****Název: Dodatečné odtoky z úvěrových a likviditních příslibů****Charakteristika:**

Přehled o maximální čerpateľné částce u nevyčerpaných neodvolatelných úvěrových a likviditních příslibů a odtoků z těchto příslibů očekávané během příštích 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 52.00 Krytí likvidity - odtoky (položky 1.4 až 1.4.7) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Vykazují se maximální částky, které mohou být vybrány z nevyčerpaných neodvolatelných úvěrových a likviditních příslibů během příštích 30 dnů. Maximální hodnota, která může být vybrána, může být snížena o hodnotu kolaterálu podle čl. 418 CRR, který bude poskytnut, pokud vykazující osoba může kolaterál znovu použít a pokud kolaterál představuje likvidní aktiva podle čl. 416 CRR. Kolaterálem, který bude poskytnut, nemohou být aktiva emitovaná protistranou příslibu nebo jí přidruženým subjektem. Pokud je to vykazující osobě známo, pak maximální hodnota, která může být vybrána z nevyčerpaných úvěrových a likviditních příslibů poskytnutých sekuritizační jednotce pro speciální účel (SSPE), bude stanovena jako maximální hodnota, kterou lze vybrat na základě vlastních závazků dané SSPE splatných během příštích 30 dnů.

Vykazuje se hodnota závazků, která má být splacena nebo vypořádána během příštích 30 dnů. Patří sem závazky, které mají nejbližší smluvní splatnost během příštích 30 dnů nebo nedefinovanou splatnost, přičemž při určení nejbližší splatnosti se bere v úvahu jak možnost výpovědi investorem, tak vykazující osobou, kde je možnost nevyužití možnosti výpovědi limitována reputačními důvody. Dále platí, že tam, kde trh očekává, že určitý závazek bude splacen během příštích 30 dnů, i když jeho smluvní termín splatnosti nebo vypořádání je delší, pak je takový závazek zahrnován do očekávaných odtoků.

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 Odtoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0208	Odtoky	
LCR0209	Odtok z úvěrových a likviditních příslibů	
LCR0210	Nevyčerpané úvěr. a likviditní přísliby pro retail.klienty	
LCR0211	Nevyčerpané úvěr. a likviditní přísliby pro jiné než retail.	
LCR0212	Nevyčerpané úvěr.přísliby pro jiné než retail. klienty a fin	
LCR0213	Nevyčerpané likviditní přísliby pro jiné než retail. klienty	
LCR0214	Nevyčerpané likviditní přísliby poskytnuté SSPE na nákup akt	

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_27

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0215	Nevyčerpané ostatní úvěr. a likviditní přísliby
LCR0216	Ostatní nevyčerpané úvěrové a likviditní přísliby poskytnuté
LCR0217	Ostatní nevyčerpané úvěrové a likviditní přísliby poskytnuté
LCR0218	Přísliby poskytnuté úvěrovým institucím
LCR0219	Nevyčerpané úvěrové přísliby poskytnuté ÚI
LCR0220	Nevyčerpané likviditní přísliby poskytnuté ÚI
LCR0221	Přísliby poskytnuté fin. inst.a investičním podnikům
LCR0222	Nevyčerpané úvěrové přísliby poskytnuté fin. institucím a in
LCR0223	Nevyčerpané likviditní přísliby poskytnuté fin. institucím a i
LCR0224	Nevyčerpané přísliby poskytnuté ostatním klientům
LCR0225	Nevyčerpané přísliby poskytnuté subjektům ve skupině
LCR0226	Nevyčerpané přísliby k financování podpůrných úvěrů
LCR0227	Ostatní podmíněné závazky
LCR0228	Ostatní podmíněné závazky poskytnuté subjektům ve skupině
LCR0229	Zvláštní požadavky na odtok likvidity

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_CECODTOK	Maximální čerpatelná částka a hodnota odtoku

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_27

**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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_31

**Název:** Přitoky z pohledávek vůči finančním a nefinančním zákazníkům

**Charakteristika:**

Přehled pohledávek vůči finančním a nefinančním zákazníkům splatných do 30 dnů a přítoků z těchto pohledávek očekávaných během příštích 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 53.00 Krytí likvidity - přítoky (položky 1.1 až 1.5) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Zahrnují se podle čl. 425 (2) CRR pouze smluvně podložené přítoky z expozic, které nejsou po splatnosti a u kterých vykazující osoba neočekává neplnění během příštích 30 dnů. Přitoky se uvádí v plné výši (bez omezení do výše limitu 75% odtoku likvidity podle čl. 425 (1) CRR). Podle čl. 425 (7) CRR se do přítoků z likvidních aktiv vykázaných podle čl. 416 zahrnují jen platby splatné za aktiva, které se neodrážejí v tržní hodnotě aktiva. Nezahrnují se podle čl. 425 (8) přítoky z jakýchkoli nově přijatých závazků.

Vykazují se hodnoty, které jsou jednoznačně zdrojem během příštích 30 dnů podle čl. 425 CRR nesnížené koeficienty podle CRR a v hodnotě odtoku, tj. po aplikaci koeficientů, tam kde je to předepsáno CRR.

Všechny položky se vykazují souhrnně v CZK bez ohledu na jejich skutečnou denominaci podle čl. 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 omezitelných požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na Přílohu XII a XIII (část Přitoky) implementačních technických standardů .

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0230	Přitoky (do výše limitu)	
LCR0231	Splátky pohledávek za nefinančními zákazníky	
LCR0232	Splátky pohledávek za retailovými zákazníky	
LCR0233	Splátky pohledávek za nefinančními podniky	
LCR0234	Splátky pohledávek za nefin. podniky související s clearinge	
LCR0235	Splátky pohledávek za centrálními bankami	
LCR0236	Splátky pohledávek za centr. bankami související s clearinge	
LCR0237	Splátky pohledávek za ostatními subjekty	
LCR0238	Splátky pohledávek za finančními zákazníky	
LCR0239	Splátky pohledávek za fin.zákazníky související s clearingem	
LCR0240	Splátky pohledávek s nižší procentní hodnotou odtoku povoleno	

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_31

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0241	Splátky pohledávek z transakcí financování obchodu
LCR0242	Splátky aktiv s neurčeným datem ukončení smlouvy
LCR0243	Splátky pohledávek z pozic v kapit. nástrojích zahrnutých do

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_UHAHP	Účetní hodnota a hodnota pří toku

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_31

**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: LIS10\_32**

**Název: Přitoky z pohledávek ze zajištěných úv. transakcí a transakc**

**Charakteristika:**

Přehled pohledávek ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na kapitálovém trhu splatných do 30 dnů a přítoků z těchto pohledávek očekávaných během příštích 30 dnů, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR, podle stupně likviditní a úvěrové kvality. Odpovídá části tabulky 53.00 Krytí likvidity - přítoky (položky 1.6 až 1.6.13.13.3) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Vykazují se všechny transakce ze zajištěných úvěrových transakcí a transakcí na kapitálovém trhu podle čl. 192 CRR. Zahrnují se transakce, v rámci kterých vykazující osoba poskytla kolateralizovaný úvěr v hotovosti (repo) podle čl. 4 (59) CRR. Uvádí se tržní hodnota odpovídajících aktiv, která zajišťují výše uvedené transakce (přijaté jako kolaterál) a hodnota splatná do 30 dnů podle stupně likvidity a úvěrové kvality.

Zahrnují se podle čl. 425 (2) CRR pouze smluvně podložené přítoky z expozic, které nejsou po splatnosti a u kterých vykazující osoba neočekává neplnění během příštích 30 dnů. Přitoky se uvádí v plné výši (bez omezení do výše limitu 75% odtoku likvidity podle čl. 425 (1) CRR). Podle čl. 425 (7) se do přítoku z likvidních aktiv vykázaných podle čl. 416 zahrnují jen platby splatné za aktiva, které se neodrážejí v tržní hodnotě. Nezahrnují se podle čl. 425 (8) o přítoku z jakýchkoli nově přijatých závazků.

Transakce se vykazují v členění podle stupně likviditní a úvěrové kvality aktiv použitých k zajištění transakcí, a to s použitím stejných kritérií jako v datové oblasti LIS10\_12 Likvidní aktiva- podle stupně likvidity a úvěrové kvality. Při členění aktiv se postupuje podle čl. 416 (1) CRR, tj. než bude stanovena jednotná definice vysoké a velmi vysoké likvidity a vysoké a velmi vysoké úvěrové kvality v souladu s čl. 460 CRR, instituce samy identifikují převoditelná aktiva (v dané měně) vysoké a velmi vysoké likviditní kvality a vysoké a velmi vysoké úvěrové kvality.

Pokud vykazující osoba vložila aktiva s velmi vysokou, vysokou a ostatní likviditní a úvěrovou kvalitou do poolu (seskupení) a jednotlivá aktiva nejsou přiřazena k jednotlivým zajištěným úvěrovým transakcím a transakcím na kapitálovém trhu, pak vykazující osoba přiřadí jako první aktiva s nejnižší likviditní a úvěrovou kvalitou (tj. ostatní aktiva), v dalším kroku přiřadí aktiva s vysokou likviditní a úvěrovou kvalitou, a až na konec přiřadí aktiva s velmi vysokou likviditní a úvěrovou kvalitou.

U výměny kolaterálu, kdy vykazující osoba souběžně přijímá a poskytuje kolaterál (v podobě jiné než hotovost), se v této datové oblasti vykazuje tržní hodnota poskytnutého kolaterálu (hodnota přijatého kolaterálu se vykáže v části Odtoky).

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 Přitoky) implementačních technických standardů.

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_32

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0244	Přítoky (do výše limitu)
LCR0245	Splátky pohledávek ze zajištěných úvěr.transakcí a z transak
LCR0246	Ostatní převoditelná aktiva vč. zaručených představující poh
LCR0247	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou nebo jimi zar
LCR0248	Pohledávky za ústřední nebo regionální vládou
LCR0249	Pohledávky zaručené ústřední nebo regionální vládou
LCR0250	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru nebo
LCR0251	Pohledávky za centr. bankami a subj. veřejného sektoru
LCR0252	Pohledávky zaručené centr. bankami nebo subj. veřejného sekt
LCR0253	Pohledávky za BMP, MMF, EK a MRB nebo jimi zaručené
LCR0254	Pohledávky za BMP, MMF, EK a MRB
LCR0255	Pohledávky zaručené BIS, MMF, EK a MRB
LCR0256	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabili
LCR0257	Pohledávky za nástrojem fin.stability a mechanismem stabilit
LCR0258	Pohledávky zaručené nástrojem fin. stability a mechanismem s
LCR0259	Akcie nebo podíly v subjektech KI s podkl.aktivy podle čl. 4
LCR0260	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (a) akcií nebo podílů
LCR0261	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (b) a (c) ) akcií nebo
LCR0262	Podkladová aktiva podle čl. 416 (1) (d) ) akcií nebo podílů
LCR0263	Aktiva vydaná ÚI zřízenou ústřední nebo regionální vládou po
LCR0264_001	*Dluhové cenné papíry nefinančních podniků
LCR0264_002	Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0264_003	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0264_004	*Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0265_001	*Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)
LCR0265_002	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú
LCR0265_003	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro
LCR0265_004	*Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro
LCR0266_001	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI
LCR0266_002	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0266_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0266_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu
LCR0267_001	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI
LCR0267_002	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI - st
LCR0267_003	*CP zajištěné hyp.úvěry na obytl. nemovitosti vydané ÚI - stu

Datový typ údajů

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_32

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0267_004	*CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI- stup
LCR0268_001	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI
LCR0268_002	*Ostatní dluhové CP vydané Ú - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0268_003	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0268_004	*Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0269_001	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0269_002	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0269_003	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0269_004	*Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou
LCR0270_001	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0270_002	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0270_003	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0270_004	*Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval
LCR0271	Aktiva dle čl. 416 (1) (b) a (d) nesplňující čl. 417 (b) a (
LCR0272	Aktiva nekontrolována funkcí řízení likvidity
LCR0273	Aktiva snadno nezpeněžitelná do 30 dnů
LCR0274	Položky podléhající doplňkovému vykazování likvidních aktiv
LCR0275	Hotovost
LCR0276	Expozice vůči centrálním bankám čerpatelné v krizové situaci
LCR0277	Pohledávky z převod. CP s RV 0%
LCR0278	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za státy
LCR0279	Pohledávky z převod. CP s RV 0% zaručené státy
LCR0280	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za centr. bankami nebo jimi
LCR0281	Pohledávky z převod. CP s RV 0% za subj. veřej.sekt., region
LCR0282	Pohledávky z převod.CP s RV 0% za BIS, MMF, EK, MRB, nástro
LCR0283	Ostatní pohledávky z převod. CP za státem nebo centr.bankou
LCR0284	Převoditelné CP s RV 20% nepředstavující závazek vyk. ani p
LCR0285	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za státy
LCR0286	Pohledávky z převod. CP s RV 20% zaručené státy
LCR0287	Pohledávky z převod. CP s RV 20%.za centr. bankami nebo jimi
LCR0288	Pohledávky z převod.CP s RV 20 % za subj. veřej.sekt., regi
LCR0289	Pohledávky z převod. CP s RV 20% za MRB nebo jimi zaručené
LCR0290	Ostatní pohledávky z převod.CP s RV 20% nebo lepší
LCR0291	Pohledávky z převod.CP s RV 50% nebo lepší
LCR0292	Pohledávky z převod.CP s RV 35% nebo lepší

Datový typ údajů

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_32

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0293	Pohotovostní úvěrové přísliby poskytované centr. bankami
LCR0294	Minimální vklady a další likvidní financování od ústřední úv
LCR0295	Kmenové akcie obchodované na burze
LCR0296	Fyzicky alokované zlato registrované na uznané burze
LCR0297	Aktiva dle čl. 417 b) a c), nesplňující podmínky čl. 416
LCR0298_001	*Dluhové CP finančních subjektů
LCR0298_002	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0298_003	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0298_004	*Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0299_001	*Vlastní emise cenných papírů
LCR0299_002	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1
LCR0299_003	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2
LCR0299_004	*Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3
LCR0300_001	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí
LCR0300_002	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0300_003	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0300_004	*Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup
LCR0301_001	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti
LCR0301_002	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0301_003	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0301_004	*Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň
LCR0302_001	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti
LCR0302_002	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup
LCR0302_003	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup
LCR0302_004	*Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup
LCR0303	Kotované akcie nebo kap.nástroje zahrnuté do hlavního indexu
LCR0304	Ostatní zlato
LCR0305	Ostatní zaručené dluhové CP
LCR0306	Ostatní kryté dluhopisy
LCR0307	Ostatní podnikové dluhové CP
LCR0308	Fondy nabývající aktiva podle čl. 509 (3) (c) CRR
LCR0309	Ostatní CP nebo pohledávky přijaté centr. bankou jako kolate
LCR0310	Dluhové CP místních vlád
LCR0311	Obchodní cenné papíry
LCR0312	Úvěrové pohledávky

**Datový typ údajů**

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_32

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0313_001	*Finanční produkty podle práva šaría
LCR0313_002	*Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit
LCR0313_003	*Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit
LCR0313_004	*Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_SĀATHK	Splatná částka a tržní hodnota kolaterálu
P0635	Likvidita a stabilní financování	Výčet : Z_LIKVIDA	Aktiva velmi vysoké likvidity a velmi vysoké úvěrové kvality

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_32

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

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b>
<b>Informační prvky</b>	Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>LCR0264_001</b> *Dluhové cenné papíry nefinančních podniků	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0264_002</b> Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0264_003</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0264_004</b> *Dluhové CP nefin. podniků - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0265_001</b> *Dluhové CP papíry vydané ÚI podle čl. 129 (4) nebo (5)	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0265_002</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) CRR - stupeň ú	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0265_003</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0265_004</b> *Dluhové CP vydané ÚI dle čl. 416 (2) (a) (i) - stupeň úvěro	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_32**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0266_001</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0266_002</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0266_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0266_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obch. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0267_001</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0267_002</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - st	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0267_003</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI - stu	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0267_004</b> *CP zajištěné hyp.úvěry na obyt. nemovitosti vydané ÚI- stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_32**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0268_001</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0268_002</b> *Ostatní dluhové CP vydané Ú - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0268_003</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0268_004</b> *Ostatní dluhové CP vydané ÚI - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0269_001</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0269_002</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0269_003</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0269_004</b> *Ostatní převod.aktiva s velmi vysokou likviditou a úvěrovou	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3



**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_32**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0270_001</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0270_002</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0270_003</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0270_004</b> *Ostatní převod. aktiva s vysokou likviditou a úvěrovou kval	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0298_001</b> *Dluhové CP finančních subjektů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0298_002</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0298_003</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0298_004</b> *Dluhové CP finančních subjektů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_32**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0299_001</b> *Vlastní emise cenných papírů	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0299_002</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 1	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0299_003</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 2	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0299_004</b> *Vlastní emise cenných papírů - stupeň úvěrové kvality 3	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0300_001</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0300_002</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0300_003</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0300_004</b> *Nezajištěné emise cenných papírů úvěrových institucí - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor: LISIFE10**

**Akronym: LIS (ČNB) 10-12**

**Datová oblast: LIS10\_32**

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0301_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0301_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0301_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0301_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp.úvěry na obch.nemovitosti - stupeň	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3
<b>LCR0302_001</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0302_002</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0302_003</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0302_004</b> *Ostatní CP zajištěné hyp. úvěry na obyt. nemovitosti - stup	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Datový soubor:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_32

<b>Parametry</b>	<b>P0633</b> Vztah na stupeň úvěrové kvality
<b>Informační prvky</b>	
<b>LCR0313_001</b> *Finanční produkty podle práva šaría	<b>Položka : S_UV_KVALITA</b> Stupeň úvěrové kvality celkem
<b>LCR0313_002</b> *Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit	<b>Položka : 10</b> Stupeň úvěrové kvality 1
<b>LCR0313_003</b> *Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit	<b>Položka : 20</b> Stupeň úvěrové kvality 2
<b>LCR0313_004</b> *Finanční produkty podle práva šaría - stupeň úvěrové kvalit	<b>Položka : 30</b> Stupeň úvěrové kvality 3

**Poznámka :**

**Verze:** 1.0  
**Zdroj:**

**Stav:** Platný  
**Garant:** /

**Platnost od:** 01.01.2014

Datová oblast: LIS10\_33

Název: Další přítoky, překročení 75 %ního limitu a přítoky vyjmuté

**Charakteristika:**

Přehled přijatých nečerpaných úvěrových a likviditních příslibů a specifikovaných pohledávek a očekávaných přítoků z těchto příslibů a pohledávek během příštích 30 dnů, dále obsahuje celkovou hodnotu pří toku odpovídajících překročení 75% limitu a rovněž přehled pohledávek splatných do 30 dnů a přítoků z těchto pohledávek očekávaných během příštích 30 dnů, jež jsou vyjmuty ze 75 %tního limitu, potřebných pro výpočet požadavku krytí likvidity podle čl. 412 CRR. Odpovídá části tabulky 53.00 Krytí likvidity - přítoky (položky 1.7 až 3.4) jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Zahrnují se podle čl. 425 (2) CRR jsou pouze smluvně podložené přítoky z expozic, které nejsou po splatnosti a u kterých vykazující osoba neočekává neplnění během příštích 30 dnů. Přítoky se uvádí v plné výši (bez omezení do výše limitu 75% odtoku likvidity podle čl. 425 (1) CRR). Podle čl. 425 (7) se do pří toku z likvidních aktiv vykázaných podle čl. 416 zahrnují jen platby splatné za aktiva, které se neodrážejí v tržní hodnotě. Nezahrnují se podle čl. 425 (8) přítoky z jakýchkoli nově přijatých závazků.

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 Přítoky) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0314	Přítoky (do výše limitu)	
LCR0315	Nevyčerpané úvěr. a likvid. přísliby a jiné přísliby s indiv	
LCR0316	Nevyčerpané úvěr. a likvid.přísliby a jiné přísliby s indivi	
LCR0317	Nevyčerpané úvěr, a likvid. přísliby a jiné přísliby s indiv	
LCR0318	Pohledávky z derivátových kontraktů	
LCR0319	Splátky likvidních aktiv neoceněných tržní hodnotou	
LCR0320	Ostatní pohledávky	
LCR0321	Peněžní prostředky z přítoků přesahující 75 %ní limit	
LCR0322	Přítoky vyjmuté ze 75 %ního limitu	
LCR0323	Splátky hypotéčních úvěrů financovaných dluhopisy vyjmuté z	
LCR0324	Splátky podpůrných úvěrů vyjmuté ze 75 %ního limitu	
LCR0325	Splátky z pohledávek vůči spřízněným podnikům a podnikům v r	

Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_33

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
LCR0326	Splátky pohledávek vůči subjektům ve skupině vyjmuté ze 75 %

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

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

Datový typ údajů

**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
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_UHAHP	Účetní hodnota a hodnota přítohu

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_33

**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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_41

**Název:** Výměna kolaterálů

**Charakteristika:**

Informace o výměně kolaterálů rozdílné kvality podle čl. 415 (1) pododstavec 2 CRR. Odpovídá tabulce 54.00 Krytí likvidity - výměna kolaterálu jednotného reportovacího rámce pro krytí likvidity (LCR) podle ITS.

Zahrnují se všechny výměny kolaterálu, kdy likvidní aktiva podle čl. 416 (1) (a), (b) a (c) byla obdržena proti kolaterálu, který nesplňuje podmínky podle čl. 416 (1) (a), (b) a (c). Aktiva, která nesplňují podmínky čl. 416 (1) (a) (b) a (c) jsou v této datové oblasti považována za ostatní aktiva.

Vykazuje se nominální a tržní hodnota aktiv podle čl. 416 (1) (a), (b) a (c), která byla přijata proti zajištění ostatními aktivy, tj. aktivy nesplňujícími podmínky podle čl. 416 (1) (a) (b) a (c). Samostatně se sledují výměny kolaterálu se splatností kratší než 30 dní a se splatností vyšší než 30 dní.

Všechny položky se vykazují souhrnně v CZK bez ohledu na jejich skutečnou denominaci podle čl. 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 omezitelnosti požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky,
- ITS odkazuje na Přílohu XII a XIII (část Výměna kolaterálu) implementačních technických standardů.

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
LCR0327	Aktiva	
LCR0328	Výměna kolaterálů - hotovost a expozice vůči centrálním bank	
LCR0329	Výměna kolaterálů - likvidní převoditelná aktiva s velmi vys	
LCR0330	Ostatní převoditelná aktiva vč. zaručených představující poh	
LCR0331	Výměna kolaterálů - pohledávky za ústřední nebo regionální	
LCR0332	Výměna kolaterálů - pohledávky za centr. bankami a subj. veř	
LCR0333	Výměna kolaterálů-pohledávky za BIS, MMF, EK a MRB nebo jimi	
LCR0334	Výměna kolaterálů - pohledávky za nástrojem fin.stability a	

**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



Datový soubor: LISIFE10

Akronym: LIS (ČNB) 10-12

Datová oblast: LIS10\_41

**Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0062	Zbytková doba splatnosti	Výčet : Z_SWAP	Swapy kolaterálu
P0586	Vztah na likviditu a stabilní financování	Výčet : Z_JHATH	Jmenovitá hodnota a tržní hodnota

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Položka : 280	Poslední den sledovaného období
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:** LISIFE10

**Akronym:** LIS (ČNB) 10-12

**Datová oblast:** LIS10\_41

**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:** /