

POPIS DATOVÉHO SOUBORU**Kód:** RISIFE28**Akronym:** V (ČNB) 28-12**Název:** Měsíční výkaz o zahraničních cenných papírech v držení banky**Charakteristika:**

Měsíční výkaz o zahraničních cenných papírech v držení banky podává přehled :

- o nákupech cenných papírů bankou na vlastní účet
- o prodeji cenných papírů bankou z vlastního účtu
- o stavech zahraničních cenných papírů v držení banky, v členění podle druhu cenného papíru (dluhové cenné papíry a majetkové cenné papíry), smluvní splatnosti dluhových cenných papírů (krátkodobé se splatností do 1 roku, dlouhodobé se splatností delší než 1 rok) a podle země sídla emitentů cenných papírů a podle sektoru emitenta

- o čistých realizovaných výnosech (dividendy, úroky, prémie po zdanění) ze zahraničních cenných papírů, které jsou nebo byly během vykazovaného období v držení banky, v členění stejném jako u stavů cenných papírů.

Nezahrnuje cenné papíry, které banka dala do repo obchodů (včetně bankou zapůjčených cenných papírů a prodaných cenných papírů s pevným závazkem zpětného nákupu).

Části datového souboru:

Část: 1 - Zahraniční CP členěné podle zemí sídla emitentů

Přiřazené datové oblasti:

Pořadí	Kód	Název
1	RIS28_01	Majetkové zahraniční cenné papíry v držení banky podle zemí
2	RIS28_02	Dluhové ZCP v držení banky se splat. nad 1rok podle zemí
3	RIS28_03	Dluhové ZCP v držení banky se splat. do 1roku podle zemí

Vykaz.povinnost: VP RISIFE28_1

Název : Vykazovací povinnost pro RISIFE28

Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0002	Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt	E	ZKOMBAN	Banky a pobočky zahraničních bank působící v ČR bez ČNB
P0046	Rozsah vykazování podle území	E	ZCR	Údaje za Českou republiku
P0053	Stav ke dni	E	d1_I1	Datum ve tvaru YYYYMMDD z přípustného intervalu

Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0012	Periodicita	=	12	Měsíční
P0060	Termín předkládání	=	M_1_12-3	Do 20. následujícího měsíce

Poznámka:

Zahraniční cenný papír je cenný papír, jehož emitentem je cizozemec (tj. právnická osoba se sídlem v zahraničí nebo fyzická osoba s trvalým pobytem v zahraničí - podle § 1 zákona č. 219/1995 Sb., devizový zákon, ve znění pozdějších předpisů), a to bez ohledu na místo emise (zahraničí i ČR) a měnu (cizí měny i Kč).

Při členění zemí jako ekonomických teritorií jsou v souladu s číselníkem zemí používaným pro statistiku platební bilance v EU/ECB zařazeny pod některé země i státy (resp. území), které jsou s nimi ekonomicky propojeny.

Stav zahraničních cenných papírů je uveden v reálných hodnotách platných ke konci vykazovaného období.

Pro přepočet cizí měny na Kč se použije průměrný kurz za vykazované období.

Kód: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Název: Měsíční výkaz o zahraničních cenných papírech v držení banky

Verze: 4.1

Stav: Platný

Platnost od: 02.01.2005

Zdroj: ČNB

Garant věcného obsahu : Moravcová/odb.417

Garant metodického popisu: Sýkorová/odb.416

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR**Datový soubor:** RISIFE28**Akronym:** V (ČNB) 28-12**Název:** Měsíční výkaz o zahraničních cenných papírech v držení banky**Datová oblast:** RIS28_01**Název:** Majetkové zahraniční cenné papíry v držení banky podle zemí**Charakteristika:**

Přehled o nákupu, prodeji, stavu a výnosech majetkových zahraničních cenných papírů v držení banky v členění podle země sídla a sektoru emitenta cenného papíru. Pokud je sídlo emitenta EU, použije se v P0125 kód 4Z. V případě akcií se zahrnují pouze ty, které spadají do portfoliových investic banky (t.j. akcie držené bankou představující méně než 10% základního kapitálu).

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>
BCP1008_001	*Stav majetkových ZCP v držení banky - reálné hodnoty
BCP1009	Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky
BCP1011	Nákup zahraničních cenných papírů (bankou na vlastní účet)
BCP1012	Prodej zahraničních cenných papírů (bankou z vlastního účtu)

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>
P0036	Objekt vykazování podle sektorů ESA95	Několik : D_20000001	Nerezidenti
P0125	Země (ekonomické teritorium)	Několik : D_S_A1TER1	Svět včetně začlenění vybraných teritorií

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0019	Struktura sledovaných měn	Položka : S_VSEMEN	Všechny měny
P0065	Smluvní doba splatnosti	Položka : 95	Nespecifikováno
P0088	Druh cenného papíru	Položka : 2	Majetkové cenné papíry

Datový soubor: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Datová oblast: RIS28_01

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0011	P0014	P0186
	Časová charakteristika	Typ ukazatele	Ocenění aktiv/pasiv
Informační prvky			
BCP1008_001 *Stav majetkových ZCP v držení banky - reálné hodnoty	Položka : 050 Poslední den sledovaného měsíce	Položka : 001 Okamžitkový údaj (stav)	Položka : 22 Reálná hodnota
BCP1009 Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	
BCP1011 Nákup zahraničních cenných papírů (bankou na vlastní účet)	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	
BCP1012 Prodej zahraničních cenných papírů (bankou z vlastního účtu)	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	

Poznámka:

Verze: 4.0	Stav: Platný	Platnost od: 01.01.2005
Zdroj: ČNB	Garant: Sýkorová / odb.416	

Datový soubor: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Datová oblast: RIS28_02

Název: Dluhové ZCP v držení banky se splat. nad 1rok podle zemí

Charakteristika:

Přehled o nákupu, prodeji, stavu a výnosech dluhových zahraničních cenných papírů (dluhopisů a směnek) se smluvní splatností nad 1 rok v držení banky v členění podle země sídla a sektoru emitenta cenného papíru. Pokud je sídlo emitenta EU, použije se v P0125 kód 4Z.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
BCP1008_002	*Stav dluhových ZCP v držení banky - reálné hodnoty	
BCP1009	Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky	
BCP1011	Nákup zahraničních cenných papírů (bankou na vlastní účet)	
BCP1012	Prodej zahraničních cenných papírů (bankou z vlastního účtu)	

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>
P0036	Objekt vykazování podle sektorů ESA95	Několik : D_20000001	Nerezidenti
P0125	Země (ekonomické teritorium)	Několik : D_S_A1TER1	Svět včetně začlenění vybraných teritorií

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0019	Struktura sledovaných měn	Položka : S_VSEMEN	Všechny měny
P0065	Smluvní doba splatnosti	Položka : 20	Nad 1 rok
P0088	Druh cenného papíru	Položka : S_DLUHCP	Dluhové cenné papíry

Datový soubor: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Datová oblast: RIS28_02

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0011 Časová charakteristika	P0014 Typ ukazatele	P0186 Ocenění aktiv/pasiv
Informační prvky			
BCP1008_002 *Stav dluhových ZCP v držení banky - reálné hodnoty	Položka : 050 Poslední den sledovaného měsíce	Položka : 001 Okamžitkový údaj (stav)	Položka : 22 Reálná hodnota
BCP1009 Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	
BCP1011 Nákup zahraničních cenných papírů (bankou na vlastní účet)	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	
BCP1012 Prodej zahraničních cenných papírů (bankou z vlastního účtu)	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	

Poznámka:

Verze: 4.0	Stav: Platný	Platnost od: 01.01.2005
Zdroj: ČNB	Garant: Sýkorová / odb.416	

Datový soubor: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Datová oblast: RIS28_03

Název: Dluhové ZCP v držení banky se splat. do 1 roku podle zemí

Charakteristika:

Přehled o nákupu, prodeji, stavech a výnosech dluhových zahraničních cenných papírů (dluhopisů a směnek) se smluvní splatností do 1 roku v držení banky v členění podle země sídla a sektoru emitenta cenného papíru. Pokud je sídlo emitenta EU, použije se v P0125 kód 4Z.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
BCP1008_002	*Stav dluhových ZCP v držení banky - reálné hodnoty	
BCP1009	Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky	
BCP1011	Nákup zahraničních cenných papírů (bankou na vlastní účet)	
BCP1012	Prodej zahraničních cenných papírů (bankou z vlastního účtu)	

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>
P0036	Objekt vykazování podle sektorů ESA95	Několik : D_20000001	Nerezidenti
P0125	Země (ekonomické teritorium)	Několik : D_S_A1TER1	Svět včetně začlenění vybraných teritorií

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0019	Struktura sledovaných měn	Položka : S_VSEMEN	Všechny měny
P0065	Smluvní doba splatnosti	Položka : 18	Do 1 roku včetně
P0088	Druh cenného papíru	Položka : S_DLUHCP	Dluhové cenné papíry

Datový soubor: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Datová oblast: RIS28_03

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0011 Časová charakteristika	P0014 Typ ukazatele	P0186 Ocenění aktiv/pasiv
Informační prvky			
BCP1008_002 *Stav dluhových ZCP v držení banky - reálné hodnoty	Položka : 050 Poslední den sledovaného měsíce	Položka : 001 Okamžitkový údaj (stav)	Položka : 22 Reálná hodnota
BCP1009 Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	
BCP1011 Nákup zahraničních cenných papírů (bankou na vlastní účet)	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	
BCP1012 Prodej zahraničních cenných papírů (bankou z vlastního účtu)	Položka : 440 Měsíc	Položka : 410 Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)	

Poznámka:

Verze: 4.0
Zdroj: ČNB

Stav: Platný
Garant: Sýkorová / odb.416
Platnost od: 01.01.2005

POPIS JEDNOVÝKAZOVÝCH KONTROL PRO DATOVÝ SOUBOR

Kód DS: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Krok kontroly: 10

Druh: err

Název:

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0125:MZZ5Z6CZ, P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.95, P0088.2;
BCP1008_001 = NULL A BCP1009 = NULL A BCP1011 = NULL A BCP1012 = NULL;

Uživatelský tvar:

PRO P0125:MZZ5Z6CZ;RIS28_01(N2,5=NULL A N2,6=NULL A N2,3=NULL A N2,4=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 20

Druh: err

Název:

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0125:MZZ5Z6CZ, P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.20,
P0088.S_DLUHCP;
BCP1008_002 = NULL A BCP1009 = NULL A BCP1011 = NULL A BCP1012 = NULL;

Uživatelský tvar:

PRO P0125:MZZ5Z6CZ;RIS28_02(N2,5=NULL A N2,6=NULL A N2,3=NULL A N2,4=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 30

Druh: err

Název:

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0125:MZZ5Z6CZ, P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.18,
P0088.S_DLUHCP;
BCP1008_002 = NULL A BCP1009 = NULL A BCP1011 = NULL A BCP1012 = NULL;

Uživatelský tvar:

PRO P0125:MZZ5Z6CZ;RIS28_03(N2,5=NULL A N2,6=NULL A N2,3=NULL A N2,4=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 1010

Druh: err

Název:

BCP1011-Nákup cenných papírů (bankou na vlastní účet) (2000000,S_A1TER) = součet
elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.95, P0088.2;
SUM BCP1011(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1011(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_01(SUM N2,3=N1,3 ODCH 10000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1020

Druh: err

Název:

BCP1012-Prodej cenných papírů (bankou z vlastního účtu) (2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.95, P0088.2;
SUM BCP1012(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1012(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_01(SUM N2,4=N1,4 ODCH 10000);

Poznámka:Krok kontroly: 1030

Druh: err

Název:

BCP1008_001-*Stav majetkových ZCP v držení banky - reálné hodnoty(2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.95, P0088.2;
SUM BCP1008_001(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1008_001(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_01(SUM N2,5=N1,5 ODCH 10000);

Poznámka:Krok kontroly: 1040

Druh: err

Název:

BCP1009-Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky(2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.95, P0088.2;
SUM BCP1009(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1009(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_01(SUM N2,6=N1,6 ODCH 10000);

Poznámka:Krok kontroly: 1050

Druh: err

Název:

BCP1011-Nákup cenných papírů (bankou na vlastní účet) (2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.20, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1011(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1011(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_02(SUM N2,3=N1,3 ODCH 10000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1060

Druh: err

Název:

BCP1012-Prodej cenných papírů (bankou z vlastního účtu) (2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.20, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1012(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1012(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_02(SUM N2,4=N1,4 ODCH 10000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1070

Druh: err

Název:

BCP1008_002-*Stav dluhových ZCP v držení banky - reálné hodnoty(2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.20, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1008_002(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1008_002(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_02(SUM N2,5=N1,5 ODCH 10000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1080

Druh: err

Název:

BCP1009-Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky(2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.20, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1009(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1009(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_02(SUM N2,6=N1,6 ODCH 10000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1090

Druh: err

Název:

BCP1011-Nákup cenných papírů (bankou na vlastní účet) (2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.18, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1011(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1011(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_03(SUM N2,3=N1,3 ODCH 10000);

Poznámka:

Kód DS: RISIFE28

Akronym: V (ČNB) 28-12

Krok kontroly: 1100

Druh: err

Název:

BCP1012-Prodej cenných papírů (bankou z vlastního účtu) (2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.18, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1012(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1012(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_03(SUM N2,4=N1,4 ODCH 10000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1110

Druh: err

Název:

BCP1008_002-*Stav dluhových ZCP v držení banky - reálné hodnoty(2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.18, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1008_002(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1008_002(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_03(SUM N2,5=N1,5 ODCH 10000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1120

Druh: err

Název:

BCP1009-Realizované výnosy z držby ZCP v držení banky(2000000,S_A1TER) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0013.100, P0019.S_VSEMEN, P0065.18, P0088.S_DLUHCP;
SUM BCP1009(P0036:MD_20000001, P0125:MD_S_A1TER1)=
BCP1009(P0036.20000000, P0125.S_A1TER) ODCH 10000;

Uživatelský tvar:

RIS28_03(SUM N2,6=N1,6 ODCH 10000);

Poznámka: